



J. Safra Sarasin

JSS Investmentfonds SICAV

Ein luxemburgischer Umbrella-Fonds
R.C.S. Nummer B 40.633

**Jahresbericht einschließlich geprüfem Abschluss
30. June 2024**

Auf der Grundlage des vorliegenden Jahresberichts einschließlich geprüftem Abschluss können keine Zeichnungen entgegengenommen werden. Zeichnungen können nur auf Basis des aktuellen ausführlichen Prospektes, der wesentlichen Anlegerinformationen (KIIDs) sowie des letzten Jahresberichts, einschließlich des geprüften Abschlusses, und gegebenenfalls des danach veröffentlichten Halbjahresberichts erfolgen.

Der ausführliche Prospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen (KIIDs) und die aktuellen Jahres- und Halbjahresberichte können kostenlos bei den in diesem Bericht aufgeführten Zahl- und Vertriebsstellen bezogen werden.

Im Folgenden werden die Namen der Teilfonds der JSS Investmentfonds SICAV (z. B. „JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets“) ohne Angabe der Umbrella-Bezeichnung „JSS Investmentfonds SICAV“ verwendet. Eine Übersicht über die vollständige Bezeichnung der einzelnen Teilfonds ist in Erläuterung 1 im Kapitel „Erläuterungen“ aufgeführt.

Inhaltsverzeichnis

Informationen	5
Organisation und Verwaltung	16
Nettoinventarwertaufstellung	18
Fondsperformance	42
Bericht der Anlageverwalter	47
Bericht des <i>Réviseur d'Entreprises Agréé</i>	51
Nettovermögensaufstellung	54
Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Netto-Fondsvermögens	62
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	71
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	80
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	86
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	88
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	92
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	95
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	97
JSS Sustainable Bond CHF	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	102
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	105
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	114
JSS Sustainable Equity - Europe	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	121
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	123
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	125
JSS Sustainable Equity - USA	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	126
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	128
JSS Sustainable Equity - Green Planet	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	141

JSS Bond - USD High Yield	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	143
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	154
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	158
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	160
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	161
JSS Equity - All China	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	163
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus	
Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte	166
Erläuterungen	168
Sonstige ungeprüfte Informationen	186
SFDR	189

Informationen*

per 30.06.2024

	Bezeichnung der Anteilsklasse	ISIN	Benchmark
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-C CHF acc hedged-	LU1073944271	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-C EUR acc hedged-	LU1073944354	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-C USD acc-	LU1073944198	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-C USD dist-	LU1210450364	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-I CHF acc hedged-	LU1073944511	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-I USD acc-	LU1073944438	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-I USD dist-	LU1210450448	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-P CHF acc hedged-	LU1073943893	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-P EUR acc hedged-	LU1073943976	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-P EUR dist hedged-	LU1244594351	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-P USD acc-	LU1073943620	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-P USD dist-	LU1210450281	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y CHF acc hedged-	LU1201473821	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y CHF dist hedged-	LU1244594948	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y EUR acc hedged-	LU1201474043	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y EUR dist hedged-	LU1244595085	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y GBP dist hedged-	LU1545798859	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y USD acc-	LU1201474126	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y USD dist-	LU1210450521	JPM Corporate Broad EMBI Diversified High Grade Index
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	-C USD acc-	LU0950588334	MSCI Emerging Markets NR Index USD
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	-C USD dist-	LU1732170136	MSCI Emerging Markets NR Index USD
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	-I USD acc-	LU1111702400	MSCI Emerging Markets NR Index USD
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	-M USD acc-	LU1860229043	MSCI Emerging Markets NR Index USD
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	-P USD dist-	LU0068337053	MSCI Emerging Markets NR Index USD
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C EUR acc-	LU0950588763	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C EUR dist-	LU1732170649	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C GBP acc-	LU1354468743	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C H1 GBP dist-	LU2592797984	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C USD acc-	LU1111702822	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C USD dist-	LU2076226567	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-E USD acc-	LU2076227615	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-E USD dist-	LU2076227532	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-I USD acc-	LU1111703044	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-I10 EUR acc-	LU2569393635	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-M USD acc-	LU2076228340	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-P EUR acc-	LU0533812276	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-P EUR dist-	LU0375216479	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-P USD acc-	LU1096892549	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-P USD dist-	LU1732170565	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-S EUR acc-	LU1842717297	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-S EUR dist-	LU1842717370	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-Y EUR dist-	LU2076227706	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-Y USD acc-	LU2076228001	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-Y USD dist-	LU2076227961	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	-C EUR acc-	LU0950589068	30% MSCI World NR Index EUR, 20% MSCI World NR Index EUR Hedged, 50% ICE BofA Euro Broad Market Index.
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	-C EUR dist-	LU1732171027	30% MSCI World NR Index EUR, 20% MSCI World NR Index EUR Hedged, 50% ICE BofA Euro Broad Market Index.
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	-P EUR acc-	LU2427701961	30% MSCI World NR Index EUR, 20% MSCI World NR Index EUR Hedged, 50% ICE BofA Euro Broad Market Index.
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	-P EUR dist-	LU0058893917	30% MSCI World NR Index EUR, 20% MSCI World NR Index EUR Hedged, 50% ICE BofA Euro Broad Market Index.
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	-S EUR acc-	LU1842716646	30% MSCI World NR Index EUR, 20% MSCI World NR Index EUR Hedged, 50% ICE BofA Euro Broad Market Index.
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-C CHF acc hedged-	LU1111708860	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-C EUR acc-	LU1111708787	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-C GBP acc hedged-	LU1111709082	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-C USD acc hedged-	LU1111708944	Keine

* siehe Erläuterung 17

Informationen* (Fortsetzung)

per 30.06.2024

	Bezeichnung der Anteilsklasse	ISIN	Benchmark
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I CHF acc hedged-	LU1111709322	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I EUR acc-	LU1111709249	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I USD acc hedged-	LU1111709595	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I USD dist hedged-	LU1244595754	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I10 CHF acc hedged-	LU2075973177	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I10 EUR acc-	LU2075973334	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I3 CHF acc hedged-	LU2075972286	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I30 CHF acc hedged-	LU1629314078	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I30 EUR acc-	LU1629313856	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I30 GBP dist hedged-	LU1629314581	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I30 USD dist hedged-	LU1629314318	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ3 CHF acc hedged-	LU2075975206	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ3 EUR acc-	LU2075975461	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ3 EUR dist-	LU2075975545	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ10 USD acc hedged-	LU2075977087	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ10 CHF acc hedged-	LU2075976600	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ10 GBP acc hedged-	LU2075977327	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-P CHF acc hedged-	LU1111708431	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-P EUR acc-	LU1111708357	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-P EUR dist-	LU1210451099	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-P USD acc hedged-	LU1111708514	Keine
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-P USD dist hedged-	LU1244595242	Keine
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-C CHF acc-	LU2076229074	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-C EUR acc-	LU0950589498	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-C EUR dist-	LU1732171373	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-C GBP acc-	LU2076229405	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-C USD acc-	LU1111703127	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I EUR acc-	LU0405184523	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I USD (BRL hedged) acc-	LU2067136072	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I USD acc-	LU1111703390	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I USD dist-	LU1991390706	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I10 CHF acc-	LU2008796604	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I10 EUR acc-	LU2008796273	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I10 USD acc-	LU2008796430	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I30 CHF acc-	LU2427699371	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-IH1 NOK acc-	LU2076230247	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-M CHF acc-	LU2499280977	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-M EUR acc-	LU0950589571	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-P EUR acc-	LU0480508919	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-P EUR dist-	LU0229773345	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-P SGD acc-	LU2361429579	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-P USD acc-	LU1111703473	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-P USD dist-	LU1732171290	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-S EUR dist-	LU2076230833	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-Y EUR acc-	LU1205684001	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-Y USD dist-	LU2161043588	MSCI World NR Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-C CHF acc hedged-	LU1073945245	ICE BofA Swiss Franc 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-C EUR acc hedged-	LU1073945328	ICE BofA Euro Currency 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-C EUR dist hedged-	LU1244596133	ICE BofA Euro Currency 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-C USD acc-	LU1073945161	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-C USD dist-	LU1210452063	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-I USD acc-	LU1073945591	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index

* siehe Erläuterung 17

Informationen* (Fortsetzung)

per 30.06.2024

	Bezeichnung der Anteilsklasse	ISIN	Benchmark
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-P CHF acc hedged-	LU1073944941	ICE BofA Swiss Franc 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-P EUR acc hedged-	LU1073945088	ICE BofA Euro Currency 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-P USD acc-	LU1073944867	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-P USD dist-	LU1210451842	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-Y CHF acc hedged-	LU1201473581	ICE BofA Swiss Franc 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-Y EUR acc hedged-	LU1201473664	ICE BofA Euro Currency 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-Y USD dist-	LU1210452659	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index
JSS Sustainable Bond CHF	-C CHF acc-	LU0950591809	SBI Foreign AAA-BBB TR Index
JSS Sustainable Bond CHF	-I CHF acc-	LU2668234284	SBI Foreign AAA-BBB TR Index
JSS Sustainable Bond CHF	-M CHF acc-	LU0950591981	SBI Foreign AAA-BBB TR Index
JSS Sustainable Bond CHF	-P CHF dist-	LU0121751324	SBI Foreign AAA-BBB TR Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-C CHF acc hedged-	LU2076224786	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-C EUR acc-	LU0950592104	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-C EUR dist-	LU1732171969	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-I EUR acc-	LU2076225163	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-10 EUR acc-	LU2794641170	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-130 EUR acc-	LU2783792133	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-P CHF dist hedged-	LU2076224273	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-P EUR acc-	LU2076223622	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-P EUR dist-	LU0158938935	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-Y CHF acc hedged-	LU2076226054	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-Y EUR acc-	LU1752454568	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-Y EUR dist-	LU1752454485	ICE BofA Euro Broad Market Index
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-C EUR acc-	LU0950591718	ICE BofA Euro Corporate Index
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-C EUR dist-	LU1732172009	ICE BofA Euro Corporate Index
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-I EUR acc-	LU0734492860	ICE BofA Euro Corporate Index
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-M EUR acc-	LU0776582891	ICE BofA Euro Corporate Index
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-P EUR dist-	LU0045164786	ICE BofA Euro Corporate Index
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-Y CHF dist hedged-	LU2312587103	ICE BofA Euro Corporate Index
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-Y EUR acc-	LU1205683706	ICE BofA Euro Corporate Index
JSS Sustainable Equity - Europe	-C EUR acc-	LU0950592369	MSCI Europe NR Index
JSS Sustainable Equity - Europe	-I EUR acc-	LU1111704018	MSCI Europe NR Index
JSS Sustainable Equity - Europe	-P EUR acc-	LU0484532444	MSCI Europe NR Index
JSS Sustainable Equity - Europe	-P EUR dist-	LU0058891119	MSCI Europe NR Index
JSS Sustainable Equity - Europe	-P USD acc-	LU1096900078	MSCI Europe NR Index
JSS Sustainable Equity - Europe	-Y EUR acc-	LU1205683888	MSCI Europe NR Index
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-C CHF acc-	LU2273127774	MSCI World Climate Paris Aligned Net Return
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-C EUR acc-	LU0950592443	MSCI World Climate Paris Aligned Net Return
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-C USD acc-	LU1111704364	MSCI World Climate Paris Aligned Net Return
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-I EUR acc-	LU1111704521	MSCI World Climate Paris Aligned Net Return
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-M CHF acc-	LU2499280894	MSCI World Climate Paris Aligned Net Return
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-M EUR acc-	LU0749004452	MSCI World Climate Paris Aligned Net Return
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-P EUR dist-	LU0097427784	MSCI World Climate Paris Aligned Net Return
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-P USD acc-	LU1111704448	MSCI World Climate Paris Aligned Net Return
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-C EUR acc-	LU0950592872	S&P Developed Property NR Index EUR
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-C EUR dist-	LU1991392827	S&P Developed Property NR Index EUR
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-I EUR acc-	LU0950592955	S&P Developed Property NR Index EUR
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-P EUR acc-	LU0288928376	S&P Developed Property NR Index EUR
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-P EUR dist-	LU1991392074	S&P Developed Property NR Index EUR
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-P USD acc-	LU1111705098	S&P Developed Property NR Index USD
JSS Sustainable Equity - USA	-C USD acc-	LU0950593094	MSCI USA NR Index

* siehe Erläuterung 17

Informationen* (Fortsetzung)

per 30.06.2024

	Bezeichnung der Anteilsklasse	ISIN	Benchmark
JSS Sustainable Equity - USA	-I EUR acc hedged-	LU2729677927	MSCI USA NR Index
JSS Sustainable Equity - USA	-I USD dist-	LU2076232961	MSCI USA NR Index
JSS Sustainable Equity - USA	-I10 USD acc-	LU2427700138	MSCI USA NR Index
JSS Sustainable Equity - USA	-P USD acc-	LU0526864581	MSCI USA NR Index
JSS Sustainable Equity - USA	-P USD dist-	LU2076232706	MSCI USA NR Index
JSS Sustainable Equity - USA	-Y USD acc-	LU1629314664	MSCI USA NR Index
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-C CHF H2 acc-	LU1111702152	Keine
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-C CHF H2 dist-	LU2273130307	Keine
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-C EUR acc-	LU0950593177	Keine
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-C USD H2 dist-	LU2273130489	Keine
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-I EUR acc-	LU1842720168	Keine
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-I EUR dist-	LU1842720242	Keine
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-I H2 CHF dist-	LU2273130562	Keine
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-I USD H2 acc-	LU1842720325	Keine
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-P CHF H2 acc-	LU1111702079	Keine
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-P CHF H2 dist-	LU2273130133	Keine
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-P EUR acc-	LU1111705338	Keine
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-P EUR dist-	LU0058892943	Keine
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-P USD H2 acc-	LU1842719665	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-C CHF H1 acc-	LU1111702236	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-C EUR acc-	LU0950593250	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-C EUR dist-	LU1732172694	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-C USD acc-	LU1111705684	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-C USD dist-	LU1732172777	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-I CHF acc-	LU1965939850	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-I EUR acc-	LU0333595519	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-I EUR dist-	LU1732172850	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-I USD acc-	LU1111705411	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-I10 EUR acc-	LU2427703074	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P CHF H1 acc -	LU1111702319	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P EUR acc-	LU0707700596	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P EUR dist-	LU0333595436	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P GBP dist-	LU1545800341	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P USD H1 acc-	LU1120832198	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P USD dist-	LU0950593417	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-S EUR dist-	LU1842716729	Keine
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-Y EUR acc-	LU1205684183	Keine
JSS Bond - USD High Yield	-C EUR acc hedged-	LU1184841341	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Bond - USD High Yield	-C USD acc-	LU1184840962	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Bond - USD High Yield	-C USD dist-	LU1210450109	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Bond - USD High Yield	-I USD (BRL hedged) acc-	LU2663598295	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Bond - USD High Yield	-I USD acc-	LU1184841770	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Bond - USD High Yield	-I USD dist-	LU1210450018	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Bond - USD High Yield	-P CHF acc hedged-	LU1184840293	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Bond - USD High Yield	-P CHF dist hedged-	LU1184840459	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Bond - USD High Yield	-P EUR acc hedged-	LU1184840533	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Bond - USD High Yield	-P EUR dist hedged-	LU1184840707	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Bond - USD High Yield	-P USD acc-	LU1184840020	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index

* siehe Erläuterung 17

Informationen* (Fortsetzung)

per 30.06.2024

	Bezeichnung der Anteilsklasse	ISIN	Benchmark
JSS Bond - USD High Yield	-P USD dist	LU1210449945	Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped TR Index
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-C CHF acc hedged	LU1332517405	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-C EUR acc hedged	LU1332517660	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-C USD acc	LU1332517231	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-C USD dist	LU1332517314	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-I CHF acc hedged	LU1332518122	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-I EUR acc hedged	LU1332518478	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-I EUR dist hedged	LU1332518551	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-I USD acc	LU1332517827	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-I USD dist	LU1332518049	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-M CHF acc hedged	LU1332518635	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-P CHF acc hedged	LU1332516852	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-P EUR acc hedged	LU1332517074	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-P EUR dist hedged	LU1332517157	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-P USD acc	LU1332516696	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-P USD dist	LU1332516779	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-Y CHF acc hedged	LU1405747244	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-Y EUR acc hedged	LU1405747327	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-Y GBP dist hedged	LU1405749539	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-Y USD acc	LU1405747087	Keine
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-Y USD dist	LU1405747160	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-C EUR acc	LU1752455532	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-C EUR dist	LU1752455615	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-C USD acc	LU1752455375	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-E EUR acc	LU2161045799	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-E EUR dist	LU2161045872	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-I USD acc	LU1752455888	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-P EUR acc	LU1752454998	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-P EUR dist	LU1752455292	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-P USD acc	LU1752454642	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-P USD dist	LU1752454725	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-Y USD acc	LU1752456001	Keine
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-Y USD dist	LU1752456266	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-C CHF acc	LU1842718345	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-C EUR acc	LU1752457405	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-C USD acc	LU1752456936	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-C USD dist	LU1752457157	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-E USD acc	LU1842717453	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-E USD dist	LU1842717537	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-I CHF acc	LU1842718691	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-I USD (BRL hedged) acc	LU1842717883	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-I USD acc	LU1752458551	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-I10 USD acc	LU2273126701	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-M USD acc	LU1842718006	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-P CHF dist	LU1842718261	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-P EUR acc	LU1752456696	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-P EUR dist	LU1752456852	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-P USD acc	LU1752456340	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-P USD dist	LU1752456423	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-Y USD acc	LU1752458049	Keine
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-Y USD dist	LU1752458478	Keine
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-C USD acc	LU1835934479	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged USD
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-C USD dist	LU1835934552	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged USD

* siehe Erläuterung 17

Informationen* (Fortsetzung)

per 30.06.2024

	Bezeichnung der Anteilsklasse	ISIN	Benchmark
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-I USD acc-	LU1835934636	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged USD
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-I USD dist-	LU1835934719	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged USD
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-M USD acc-	LU1835935013	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged USD
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-P USD acc-	LU1835934123	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged USD
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-P USD dist-	LU1835934396	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged USD
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-Y USD acc-	LU1835934800	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged USD
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-Y USD dist-	LU1835934982	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified Composite Unhedged USD
JSS Equity - All China	-C CHF acc-	LU1965940783	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-C EUR acc-	LU1965940510	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-C USD acc-	LU1900873875	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-C USD dist-	LU1900873958	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-I CHF acc-	LU1965941161	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-I EUR acc-	LU1965940940	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-I USD acc-	LU1900874097	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-I10 USD acc-	LU2273125992	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-P CHF acc-	LU1965940353	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-P CHF dist-	LU1965940437	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-P EUR acc-	LU1965940197	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-P USD acc-	LU1900873529	MSCI China All Shares NR Index
JSS Equity - All China	-P USD dist-	LU1900873792	MSCI China All Shares NR Index
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus	-C CHF acc-	LU2611736625	SPI Swiss Small & Middle Companies CHF TR
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus	-C EUR acc-	LU2611736971	SPI Swiss Small & Middle Companies CHF TR
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus	-C USD acc hedged-	LU2611736112	SPI Swiss Small & Middle Companies CHF TR
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus	-I CHF acc-	LU2611735734	SPI Swiss Small & Middle Companies CHF TR
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus	-P CHF acc-	LU2611734414	SPI Swiss Small & Middle Companies CHF TR

* siehe Erläuterung 17

Informationen* (Fortsetzung)

Total Expense Ratio per 30.06.2024

	ISIN-Nummer	TER mit Performancegebühr	% der Performancegebühr
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C CHF acc hedged-	LU1073944271	1.21	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C EUR acc hedged-	LU1073944354	1.22	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C USD acc-	LU1073944198	1.23	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C USD dist-	LU1210450364	1.24	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -I USD acc-	LU1073944438	1.03	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -I USD dist-	LU1210450448	1.03	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P CHF acc hedged-	LU1073943893	1.67	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P EUR acc hedged-	LU1073943976	1.68	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P EUR dist hedged-	LU1244594351	1.68	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P USD acc-	LU1073943620	1.68	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P USD dist-	LU1210450281	1.68	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y CHF acc hedged-	LU1201473821	0.87	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y CHF dist hedged-	LU1244594948	0.87	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y EUR acc hedged-	LU1201474043	0.87	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y EUR dist hedged-	LU1244595085	0.87	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y GBP dist hedged-	LU1545798859	0.87	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y USD acc-	LU1201474126	0.87	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y USD dist-	LU1210450521	0.87	-
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -C USD acc-	LU0950588334	1.42	-
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -C USD dist-	LU1732170136	1.44	-
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -I USD acc-	LU1111702400	1.15	-
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -M USD acc-	LU1860229043	0.42	-
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -P USD dist-	LU0068337053	1.94	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C EUR acc-	LU0950588763	1.32	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C EUR dist-	LU1732170649	1.32	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C GBP acc-	LU1354468743	1.31	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C H1 GBP dist-	LU2592797984	1.32	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C USD acc-	LU1111702822	1.32	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C USD dist-	LU2076226567	1.31	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -E USD acc-	LU2076227615	1.62	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -E USD dist-	LU2076227532	1.62	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -I USD acc-	LU1111703044	0.96	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -I10 EUR acc-	LU2569393635	0.84	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -M USD acc-	LU2076228340	0.27	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P EUR acc-	LU0533812276	1.82	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P EUR dist-	LU0375216479	1.82	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P USD acc-	LU1096892549	1.82	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P USD dist-	LU1732170565	1.81	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -S EUR acc-	LU1842717297	1.06	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -S EUR dist-	LU1842717370	1.06	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -Y EUR dist-	LU2076227706	0.92	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -Y USD acc-	LU2076228001	0.91	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -Y USD dist-	LU2076227961	0.91	-
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -C EUR acc-	LU0950589068	1.37	-
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -C EUR dist-	LU1732171027	1.37	-
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -P EUR acc-	LU2427701961	1.89	-
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -P EUR dist-	LU0058893917	1.88	-
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -S EUR acc-	LU1842716646	1.12	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C CHF acc hedged-	LU1111708860	1.26	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C EUR acc-	LU1111708787	1.26	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C GBP acc hedged-	LU1111709082	1.26	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C USD acc hedged-	LU1111708944	1.25	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I CHF acc hedged-	LU1111709322	0.69	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I EUR acc-	LU1111709249	0.69	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I USD acc hedged-	LU1111709595	0.69	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I USD dist hedged-	LU1244595754	0.67	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I10 CHF acc hedged-	LU2075973177	0.64	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I10 EUR acc-	LU2075973334	0.64	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I3 CHF acc hedged-	LU2075972286	0.69	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 CHF acc hedged-	LU1629314078	0.59	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 EUR acc-	LU1629313856	0.59	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 GBP dist hedged-	LU1629314581	0.55**	-

* siehe Erläuterung 17

** annualisierte TER

Informationen* (Fortsetzung)

Total Expense Ratio per 30.06.2024

	ISIN-Nummer	TER mit Performance-gebühr	% der Performance-gebühr
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ3 CHF acc hedged-	LU2075975206	0.69	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ3 EUR acc-	LU2075975461	0.68	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ3 EUR dist-	LU2075975545	0.69	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ10 USD acc hedged-	LU2075977087	0.59**	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ10 CHF acc hedged-	LU2075976600	0.66	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ10 GBP acc hedged-	LU2075977327	0.64	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P CHF acc hedged-	LU1111708431	1.36	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P EUR acc-	LU1111708357	1.36	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P EUR dist-	LU1210451099	1.36	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P USD acc hedged-	LU1111708514	1.35	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P USD dist hedged-	LU1244595242	1.36	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C CHF acc-	LU2076229074	1.57	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C EUR acc-	LU0950589498	1.56	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C EUR dist-	LU1732171373	1.56	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C GBP acc-	LU2076229405	1.56	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C USD acc-	LU1111703127	1.57	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I EUR acc-	LU0405184523	1.42	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I USD (BRL hedged) acc-	LU2067136072	1.09	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I USD acc-	LU1111703390	1.42	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I USD dist-	LU1991390706	1.42	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I10 CHF acc-	LU2008796604	0.92	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I10 EUR acc-	LU2008796273	0.93	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I10 USD acc-	LU2008796430	0.93	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I30 CHF acc-	LU2427699371	0.85**	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -IH1 NOK acc-	LU2076230247	1.43	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -M CHF acc-	LU2499280977	0.39**	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -M EUR acc-	LU0950589571	0.38	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P EUR acc-	LU0480508919	2.07	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P EUR dist-	LU0229773345	2.07	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P SGD acc-	LU2361429579	2.08	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P USD acc-	LU1111703473	2.07	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P USD dist-	LU1732171290	2.07	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -S EUR dist-	LU2076230833	1.05	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -Y EUR acc-	LU1205684001	0.92	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -Y USD dist-	LU2161043588	0.91	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C CHF acc hedged-	LU1073945245	1.02	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C EUR acc hedged-	LU1073945328	1.02	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C EUR dist hedged-	LU1244596133	1.02	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C USD acc-	LU1073945161	1.02	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C USD dist-	LU1210452063	1.02	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -I USD acc-	LU1073945591	0.78	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P CHF acc hedged-	LU1073944941	1.12	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P EUR acc hedged-	LU1073945088	1.12	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P USD acc-	LU1073944867	1.12	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P USD dist-	LU1210451842	1.12	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -Y CHF acc hedged-	LU1201473581	0.72	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -Y EUR acc hedged-	LU1201473664	0.71	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -Y USD dist-	LU1210452659	0.72	-
JSS Sustainable Bond CHF -C CHF acc-	LU0950591809	0.86	-
JSS Sustainable Bond CHF -I CHF acc-	LU2668234284	0.73	-
JSS Sustainable Bond CHF -M CHF acc-	LU0950591981	0.46	-
JSS Sustainable Bond CHF -P CHF dist-	LU0121751324	1.11	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -C CHF acc hedged-	LU2076224786	0.81	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -C EUR acc-	LU0950592104	0.81	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -C EUR dist-	LU1732171969	0.81	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -I EUR acc-	LU2076225163	0.58	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -I10 EUR acc-	LU2794641170	0.47	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -I30 EUR acc-	LU2783792133	0.47	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -P CHF dist hedged-	LU2076224273	1.06	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -P EUR acc-	LU2076223622	1.06	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -P EUR dist-	LU0158938935	1.06	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -Y CHF acc hedged-	LU2076226054	0.68	-

* siehe Erläuterung 17

** annualisierte TER

Informationen* (Fortsetzung)

Total Expense Ratio per 30.06.2024

	ISIN-Nummer	TER mit Performance-gebühr	% der Performance-gebühr
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -Y EUR acc-	LU1752454568	0.68	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -Y EUR dist-	LU1752454485	0.68	-
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -C EUR acc-	LU0950591718	0.84	-
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -C EUR dist-	LU1732172009	0.84	-
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -I EUR acc-	LU0734492860	0.70	-
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -M EUR acc-	LU0776582891	0.39	-
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -P EUR dist-	LU0045164786	1.09	-
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -Y CHF dist hedged-	LU2312587103	0.69	-
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -Y EUR acc-	LU1205683706	0.69	-
JSS Sustainable Equity - Europe -C EUR acc-	LU0950592369	1.37	-
JSS Sustainable Equity - Europe -I EUR acc-	LU1111704018	0.95	-
JSS Sustainable Equity - Europe -P EUR acc-	LU0484532444	1.72	-
JSS Sustainable Equity - Europe -P EUR dist-	LU0058891119	1.72	-
JSS Sustainable Equity - Europe -P USD acc-	LU1096900078	1.72	-
JSS Sustainable Equity - Europe -Y EUR acc-	LU1205683888	0.78	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -C CHF acc-	LU2273127774	1.33	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -C EUR acc-	LU0950592443	1.33	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -C USD acc-	LU1111704364	1.33	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -I EUR acc-	LU1111704521	1.08	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -M CHF acc-	LU2499280894	0.28	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -M EUR acc-	LU0749004452	0.29	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -P EUR dist-	LU0097427784	1.83	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -P USD acc-	LU1111704448	1.83	-
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -C EUR acc-	LU0950592872	1.38	-
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -C EUR dist-	LU1991392827	1.39	-
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -I EUR acc-	LU0950592955	1.25	-
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -P EUR acc-	LU0288928376	1.89	-
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -P EUR dist-	LU1991392074	1.89	-
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -P USD acc-	LU1111705098	1.89	-
JSS Sustainable Equity - USA -C USD acc-	LU0950593094	1.31	-
JSS Sustainable Equity - USA -I EUR acc hedged-	LU2729677927	0.98	-
JSS Sustainable Equity - USA -I USD dist-	LU2076232961	0.97	-
JSS Sustainable Equity - USA -I10 USD acc-	LU2427700138	0.87	-
JSS Sustainable Equity - USA -P USD acc-	LU0526864581	1.71	-
JSS Sustainable Equity - USA -P USD dist-	LU2076232706	1.71	-
JSS Sustainable Equity - USA -Y USD acc-	LU1629314664	0.71	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -C CHF H2 acc-	LU1111702152	1.30	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -C CHF H2 dist-	LU2273130307	1.30	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -C EUR acc-	LU0950593177	1.28	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -C USD H2 dist-	LU2273130489	1.28	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -I EUR acc-	LU1842720168	0.91	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -I EUR dist-	LU1842720242	0.89**	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -I H2 CHF dist-	LU2273130562	0.91	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -I USD H2 acc-	LU1842720325	0.91**	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P CHF H2 acc-	LU1111702079	1.77	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P CHF H2 dist-	LU2273130133	1.79	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P EUR acc-	LU1111705338	1.75	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P EUR dist-	LU0058892943	1.77	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P USD H2 acc-	LU1842719665	1.77	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C CHF H1 acc-	LU1111702236	1.67	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C EUR acc-	LU0950593250	1.67	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C EUR dist-	LU1732172694	1.67	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C USD acc-	LU1111705684	1.67	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C USD dist-	LU1732172777	1.67	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I CHF acc-	LU1965939850	1.06	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I EUR acc-	LU0333595519	1.07	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I EUR dist-	LU1732172850	1.07	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I USD acc-	LU1111705411	1.09	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I10 EUR acc-	LU2427703074	0.98	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P CHF H1 acc -	LU1111702319	2.07	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P EUR acc-	LU0707700596	2.07	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P EUR dist-	LU0333595436	2.07	-

* siehe Erläuterung 17

** annualisierte TER

Informationen* (Fortsetzung)

Total Expense Ratio per 30.06.2024

	ISIN-Nummer	TER mit Performance-gebühr	% der Performance-gebühr
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P GBP dist-	LU1545800341	2.07	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P USD H1 acc-	LU1120832198	2.07	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P USD dist-	LU0950593417	2.07	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -S EUR dist-	LU1842716729	1.31	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -Y EUR acc-	LU1205684183	0.91	-
JSS Bond - USD High Yield -C EUR acc hedged-	LU1184841341	1.46	-
JSS Bond - USD High Yield -C USD acc-	LU1184840962	1.47	-
JSS Bond - USD High Yield -C USD dist-	LU1210450109	1.47	-
JSS Bond - USD High Yield -I USD (BRL hedged) acc-	LU2663598295	0.91	-
JSS Bond - USD High Yield -I USD acc-	LU1184841770	1.23	-
JSS Bond - USD High Yield -I USD dist-	LU1210450018	1.22	-
JSS Bond - USD High Yield -P CHF acc hedged-	LU1184840293	1.77	-
JSS Bond - USD High Yield -P CHF dist hedged-	LU1184840459	1.77	-
JSS Bond - USD High Yield -P EUR acc hedged-	LU1184840533	1.77	-
JSS Bond - USD High Yield -P EUR dist hedged-	LU1184840707	1.77	-
JSS Bond - USD High Yield -P USD acc-	LU1184840020	1.77	-
JSS Bond - USD High Yield -P USD dist-	LU1210449945	1.77	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C CHF acc hedged-	LU1332517405	0.97	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C EUR acc hedged-	LU1332517660	0.96	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C USD acc-	LU1332517231	0.97	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C USD dist-	LU1332517314	0.97	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I CHF acc hedged-	LU1332518122	0.78	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I EUR acc hedged-	LU1332518478	0.77	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I EUR dist hedged-	LU1332518551	0.77	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I USD acc-	LU1332517827	0.78	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I USD dist-	LU1332518049	0.78	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -M CHF acc hedged-	LU1332518635	0.40	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P CHF acc hedged-	LU1332516852	1.32	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P EUR acc hedged-	LU1332517074	1.32	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P EUR dist hedged-	LU1332517157	1.32	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P USD acc-	LU1332516696	1.32	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P USD dist-	LU1332516779	1.32	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y CHF acc hedged-	LU1405747244	0.65	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y EUR acc hedged-	LU1405747327	0.65	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y GBP dist hedged-	LU1405749539	0.66	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y USD acc-	LU1405747087	0.66	-
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y USD dist-	LU1405747160	0.66	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -C EUR acc-	LU1752455532	1.43	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -C EUR dist-	LU1752455615	1.44	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -C USD acc-	LU1752455375	1.43	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -E EUR acc-	LU2161045799	1.63	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -E EUR dist-	LU2161045872	1.63	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -I USD acc-	LU1752455888	1.15	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P EUR acc-	LU1752454998	2.03	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P EUR dist-	LU1752455292	2.03	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P USD acc-	LU1752454642	2.03	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P USD dist-	LU1752454725	2.03	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -Y USD acc-	LU1752456001	1.02	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -Y USD dist-	LU1752456266	1.02	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C CHF acc-	LU1842718345	1.33	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C EUR acc-	LU1752457405	1.33	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C USD acc-	LU1752456936	1.33	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C USD dist-	LU1752457157	1.33	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -E USD acc-	LU1842717453	1.63	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -E USD dist-	LU1842717537	1.63	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I CHF acc-	LU1842718691	1.08	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I USD (BRL hedged) acc-	LU1842717883	1.15	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I USD acc-	LU1752458551	1.09	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I10 USD acc-	LU2273126701	0.98	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -M USD acc-	LU1842718006	0.40	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P CHF dist-	LU1842718261	1.93	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P EUR acc-	LU1752456696	1.93	-

* siehe Erläuterung 17

Informationen* (Fortsetzung)

Total Expense Ratio per 30.06.2024

	ISIN-Nummer	TER mit Performance-gebühr	% der Performance-gebühr
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P EUR dist-	LU1752456852	1.93	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P USD acc-	LU1752456340	1.93	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P USD dist-	LU1752456423	1.93	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -Y USD acc-	LU1752458049	0.94	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -Y USD dist-	LU1752458478	0.92	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -C USD acc-	LU1835934479	1.55	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -C USD dist-	LU1835934552	1.56	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -I USD acc-	LU1835934636	1.07	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -I USD dist-	LU1835934719	1.07	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -M USD acc-	LU1835935013	0.70	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -P USD acc-	LU1835934123	2.10	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -P USD dist-	LU1835934396	2.08	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -Y USD acc-	LU1835934800	0.92	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -Y USD dist-	LU1835934982	0.95	-
JSS Equity - All China -C CHF acc-	LU1965940783	1.62	-
JSS Equity - All China -C EUR acc-	LU1965940510	1.62	-
JSS Equity - All China -C USD acc-	LU1900873875	1.62	-
JSS Equity - All China -C USD dist-	LU1900873958	1.63	-
JSS Equity - All China -I CHF acc-	LU1965941161	1.29	-
JSS Equity - All China -I EUR acc-	LU1965940940	1.29	-
JSS Equity - All China -I USD acc-	LU1900874097	1.28	-
JSS Equity - All China -I10 USD acc-	LU2273125992	1.17**	-
JSS Equity - All China -P CHF acc-	LU1965940353	2.03	-
JSS Equity - All China -P CHF dist-	LU1965940437	2.03	-
JSS Equity - All China -P EUR acc-	LU1965940197	2.03	-
JSS Equity - All China -P USD acc-	LU1900873529	2.03	-
JSS Equity - All China -P USD dist-	LU1900873792	2.02	-
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus -C CHF acc-	LU2611736625	1.55	-
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus -C EUR acc-	LU2611736971	1.57	-
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus -C USD acc hedged-	LU2611736112	1.50	-
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus -I CHF acc-	LU2611735734	1.27	-
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus -P CHF acc-	LU2611734414	1.99	-

* siehe Erläuterung 17

** annualisierte TER

Organisation und Verwaltung

Eingetragener Sitz der Gesellschaft

11-13, Boulevard de la Foire,
L-1528 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsgesellschaft

J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A.,
11-13, Boulevard de la Foire,
L-1528 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsrat der Gesellschaft

Urs Oberer (Präsident),
Geschäftsführer,
Bank J. Safra Sarasin AG,
Basel, Schweiz

Jules Ronald Moor,
Geschäftsführer (CEO Luxembourg),
Banque J. Safra Sarasin (Luxembourg) S.A.,
Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Ronnie Neefs
Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Claude Niedner,
Partner,
Arendt & Medernach S.A.,
Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Geschäftsleitung der Verwaltungsgesellschaft

Leonardo Mattos,
Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Valter Rinaldi,
Basel, Schweiz

Ronnie Neefs,
Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

Anlageverwalter

Bank J. Safra Sarasin AG,

Elisabethenstrasse 62,
CH-4051 Basel, Schweiz

Verwaltete Teilfonds:

JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets,
JSS Sustainable Equity - Global Dividend,
JSS Sustainable Bond CHF,
JSS Sustainable Bond - Euro Broad,
JSS Sustainable Bond EUR Corporates,
JSS Sustainable Equity - Europe,
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035,
JSS Sustainable Equity - USA,
JSS Sustainable Equity - Green Planet,
JSS Sustainable Bond - Total Return Global,
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities,
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer,
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors,
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency,
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG,
JSS Sustainable Bond - Global Short-term.

Sarasin & Partners LLP,

Juxon House, 100 St. Paul's Churchyard,
London EC4M 8BU, Vereinigtes Königreich

Verwaltete Teilfonds:

JSS Sustainable Equity - Global Thematic,
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global,
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR).

Twelve Capital AG

Dufourstrasse 101,
CH-8008 Zürich, Schweiz

Verwaltete Teilfonds:

JSS Twelve Sustainable Insurance Bond.

Federated Investment Counseling

1001 Liberty Avenue,
Pittsburgh, PA 15222,
Pennsylvania, Vereinigte Staaten von Amerika

Verwaltete Teilfonds:

JSS Bond - USD High Yield.

China Asset Management Co. Ltd.

Zone A, Tianzhu Airport Industrial Zone,
Shunyi District,
Peking,
Volksrepublik China

Verwaltete Teilfonds:

JSS Equity - All China

VV Vermögensverwaltung AG, Zug.

Chamerstrasse 12c,
CH-6300 Zug, Schweiz

Verwaltete Teilfonds:

JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus

Organisation und Verwaltung (Fortsetzung)

Verwahrstelle & Zahlstelle

CACEIS Bank, Luxembourg Branch*,
5, Allée Scheffer,
L-2520 Luxembourg,
Großherzogtum Luxemburg

Zentralverwaltung, Domizil-, Register- und Transferstelle

CACEIS Bank, Luxembourg Branch*
5, Allée Scheffer,
L-2520 Luxembourg,
Großherzogtum Luxemburg

Zahlstelle für die Schweiz

Bank J. Safra Sarasin AG,
Elisabethenstrasse 62,
CH-4002 Basel, Schweiz

Vertreter in der Schweiz

J. Safra Sarasin Investmentfonds AG,
Wallstrasse 9,
CH-4002 Basel, Schweiz

Italienische Zahlstellen

State Street S.p.A.,
Via Ferrante Aporti, 10,
I-20125 Mailand, Italien

Société Générale Securities Services S.p.A.,
Via Benigno Crespi 19/A - MAC2,
I-20159 Mailand, Italien

Allfunds Bank S.A., Italian Branch,
Via Santa Margherita, 7
I-20121 Mailand, Italien

Zentralisierungsstelle in Frankreich

Caceis Bank France S.A.
12 place des États-Unis,
CS 40083 - 92549 Montrouge Cedex

Informationsstelle in Gibraltar

Bank J. Safra Sarasin (Gibraltar) Ltd.
57/63 Line Wall Road
P.O. Box 452, Gibraltar

Facility Agent und Zahlstelle in Großbritannien

Sarasin & Partners LLP,
Juxon House, 100 St. Paul's Churchyard,
London EC4M 8BU, Großbritannien

Zahlstelle in Schweden

SEB Skandinaviska Enskilda Banken AG,
Merchant Banking,
SE-10640 Stockholm, Schweden

Cabinet de révision agréé

Deloitte Audit,
Société à responsabilité limitée,
20, Boulevard de Kockelscheuer,
L-1821 Luxembourg, Großherzogtum Luxemburg

Rechtsberater

Arendt & Medernach S.A.,
41A, avenue J.F Kennedy,
L-2082 Luxembourg, Großherzogtum Luxemburg

* Siehe Erläuterung 17.

Nettoinventarwertaufstellung*

Nettoinventarwertaufstellung

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C CHF acc hedged- LU1073944271			
Nettovermögen	33 068.00	236 696.70	232 947.71
Nettoinventarwert pro Aktie	82.67	81.15	82.70
Im Umlauf befindliche Aktien	400.00	2 916.78	2 816.78
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C EUR acc hedged- LU1073944354			
Nettovermögen	848 182.24	177 452.45	149 841.24
Nettoinventarwert pro Aktie	85.51	82.16	82.93
Im Umlauf befindliche Aktien	9 919.10	2 159.84	1 806.84
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C USD acc- LU1073944198			
Nettovermögen	4 974 393.15	4 855 260.09	5 348 950.51
Nettoinventarwert pro Aktie	120.06	113.02	110.81
Im Umlauf befindliche Aktien	41 432.56	42 959.30	48 271.37
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C USD dist- LU1210450364			
Nettovermögen	1 289 784.35	5 693 192.56	6 142 307.32
Nettoinventarwert pro Aktie	91.02	88.72	89.76
Im Umlauf befindliche Aktien	14 170.34	64 170.34	68 430.34
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -I CHF acc hedged- LU1073944511			
Nettovermögen	-	-	3 909 120.00
Nettoinventarwert pro Aktie	-	-	81.44
Im Umlauf befindliche Aktien	-	-	48 000.00
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -I USD acc- LU1073944438			
Nettovermögen	81 735 451.50	149 749 914.79	155 342 446.64
Nettoinventarwert pro Aktie	122.57	115.16	112.70
Im Umlauf befindliche Aktien	666 847.12	1 300 363.97	1 378 371.31
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -I USD dist- LU1210450448			
Nettovermögen	1 034 482.61	6 369 063.63	8 855 326.13
Nettoinventarwert pro Aktie	88.49	86.28	87.30
Im Umlauf befindliche Aktien	11 690.39	73 818.54	101 435.58
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P CHF acc hedged- LU1073943893			
Nettovermögen	2 292 608.46	2 880 454.09	3 058 591.44
Nettoinventarwert pro Aktie	77.03	75.96	77.77
Im Umlauf befindliche Aktien	29 762.54	37 920.67	39 328.68
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P EUR acc hedged- LU1073943976			
Nettovermögen	9 121 377.51	9 363 509.00	10 087 627.48
Nettoinventarwert pro Aktie	76.57	73.79	74.80
Im Umlauf befindliche Aktien	119 124.69	126 894.01	134 861.33
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P EUR dist hedged- LU1244594351			
Nettovermögen	637 578.19	641 543.80	668 790.84
Nettoinventarwert pro Aktie	75.53	75.11	78.30
Im Umlauf befindliche Aktien	8 441.39	8 541.39	8 541.39
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P USD acc- LU1073943620			
Nettovermögen	41 821 685.78	53 295 788.75	60 619 004.64
Nettoinventarwert pro Aktie	115.12	108.86	107.22
Im Umlauf befindliche Aktien	363 287.75	489 581.01	565 370.31
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P USD dist- LU1210450281			
Nettovermögen	11 376 512.82	17 571 906.76	19 105 492.68
Nettoinventarwert pro Aktie	90.64	88.35	89.37
Im Umlauf befindliche Aktien	125 513.16	198 889.72	213 779.71

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y CHF acc hedged- LU1201473821			
Nettovermögen	22 062 167.26	26 209 814.83	33 939 048.75
Nettoinventarwert pro Aktie	82.98	81.15	82.41
Im Umlauf befindliche Aktien	265 873.31	322 979.85	411 831.68
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y CHF dist hedged- LU1244594948			
Nettovermögen	2 656 265.92	2 303 464.06	3 101 706.87
Nettoinventarwert pro Aktie	75.04	76.39	80.44
Im Umlauf befindliche Aktien	35 398.00	30 154.00	38 559.26
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y EUR acc hedged- LU1201474043			
Nettovermögen	38 157 320.11	40 869 945.96	44 894 927.63
Nettoinventarwert pro Aktie	82.49	78.85	79.31
Im Umlauf befindliche Aktien	462 569.04	518 325.25	566 068.94
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y EUR dist hedged- LU1244595085			
Nettovermögen	636 484.00	629 261.50	612 256.00
Nettoinventarwert pro Aktie	77.62	77.21	80.56
Im Umlauf befindliche Aktien	8 200.00	8 150.00	7 600.00
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y GBP dist hedged- LU1545798859			
Nettovermögen	3 748 600.44	5 097 029.74	4 508 423.11
Nettoinventarwert pro Aktie	81.20	79.45	81.53
Im Umlauf befindliche Aktien	46 165.03	64 153.93	55 297.72
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y USD acc- LU1201474126			
Nettovermögen	297 823.98	2 393 686.60	3 770 007.00
Nettoinventarwert pro Aktie	123.99	116.30	113.64
Im Umlauf befindliche Aktien	2 402.00	20 582.00	33 175.00
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y USD dist- LU1210450521			
Nettovermögen	47 236 817.81	48 882 079.19	59 794 094.59
Nettoinventarwert pro Aktie	83.34	81.25	82.22
Im Umlauf befindliche Aktien	566 796.47	601 625.59	727 245.13
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -C USD acc- LU0950588334			
Nettovermögen	395 776.06	785 417.61	864 552.64
Nettoinventarwert pro Aktie	259.07	257.71	266.18
Im Umlauf befindliche Aktien	1 527.68	3 047.68	3 248.00
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -C USD dist- LU1732170136			
Nettovermögen	363 556.54	516 140.89	540 248.81
Nettoinventarwert pro Aktie	70.03	69.66	71.95
Im Umlauf befindliche Aktien	5 191.44	7 409.43	7 508.67
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -I USD acc- LU1111702400			
Nettovermögen	11 148 471.24	10 579 347.04	9 249 455.52
Nettoinventarwert pro Aktie	68.01	67.46	69.48
Im Umlauf befindliche Aktien	163 924.00	156 824.00	133 124.00
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -M USD acc- LU1860229043			
Nettovermögen	-	1 930 690.00	-
Nettoinventarwert pro Aktie	-	94.18	-
Im Umlauf befindliche Aktien	-	20 500.00	-
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -P USD dist- LU0068337053			
Nettovermögen	23 173 115.98	26 729 237.39	29 420 041.67
Nettoinventarwert pro Aktie	244.97	244.91	254.22
Im Umlauf befindliche Aktien	94 595.73	109 139.02	115 726.70

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C EUR acc- LU0950588763			
Nettovermögen	16 210 997.80	11 331 754.10	10 257 113.64
Nettoinventarwert pro Aktie	151.61	136.97	125.59
Im Umlauf befindliche Aktien	106 925.65	82 731.65	81 671.42
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C EUR dist- LU1732170649			
Nettovermögen	8 126 313.27	6 955 618.07	2 987 789.42
Nettoinventarwert pro Aktie	146.55	134.31	124.62
Im Umlauf befindliche Aktien	55 450.79	51 787.79	23 975.20
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C GBP acc- LU1354468743			
Nettovermögen	340 559.01	500 750.00	-
Nettoinventarwert pro Aktie	109.52	100.15	-
Im Umlauf befindliche Aktien	3 109.56	5 000.00	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C H1 GBP dist- LU2592797984			
Nettovermögen	1 131 600.00	1 032 200.00	-
Nettoinventarwert pro Aktie	113.16	103.22	-
Im Umlauf befindliche Aktien	10 000.00	10 000.00	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C USD acc- LU1111702822			
Nettovermögen	9 353 851.51	7 438 954.71	7 843 358.45
Nettoinventarwert pro Aktie	133.76	123.01	108.09
Im Umlauf befindliche Aktien	69 930.11	60 474.39	72 563.22
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C USD dist- LU2076226567			
Nettovermögen	3 603 488.06	1 626 481.43	779 416.07
Nettoinventarwert pro Aktie	120.76	112.66	100.16
Im Umlauf befindliche Aktien	29 840.08	14 437.08	7 781.71
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -E USD acc- LU2076227615			
Nettovermögen	3 649 205.74	3 322 351.51	3 982 416.63
Nettoinventarwert pro Aktie	143.94	132.77	117.01
Im Umlauf befindliche Aktien	25 352.27	25 023.36	34 034.84
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -E USD dist- LU2076227532			
Nettovermögen	2 124 600.09	2 087 532.00	5 217 464.88
Nettoinventarwert pro Aktie	141.31	131.83	116.18
Im Umlauf befindliche Aktien	15 035.03	15 835.03	44 908.46
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -I USD acc- LU1111703044			
Nettovermögen	7 221 463.35	10 354 475.28	261 957.00
Nettoinventarwert pro Aktie	112.51	103.10	90.33
Im Umlauf befindliche Aktien	64 185.08	100 431.38	2 900.00
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -I10 EUR acc- LU2569393635			
Nettovermögen	15 614 725.82	10 862 774.52	-
Nettoinventarwert pro Aktie	113.65	102.19	-
Im Umlauf befindliche Aktien	137 393.10	106 299.78	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -M USD acc- LU2076228340			
Nettovermögen	34 659 537.60	33 415 657.50	23 256 074.40
Nettoinventarwert pro Aktie	114.32	104.05	90.48
Im Umlauf befindliche Aktien	303 180.00	321 150.00	257 030.00
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P EUR acc- LU0533812276			
Nettovermögen	22 292 211.18	20 896 891.19	14 691 789.48
Nettoinventarwert pro Aktie	325.65	295.67	272.47
Im Umlauf befindliche Aktien	68 454.51	70 676.40	53 920.76

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P EUR dist- LU0375216479			
Nettovermögen	9 399 263.18	8 852 598.46	8 173 382.08
Nettoinventarwert pro Aktie	279.85	256.49	237.79
Im Umlauf befindliche Aktien	33 586.79	34 514.40	34 372.27
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P USD acc- LU1096892549			
Nettovermögen	27 581 562.28	31 136 233.76	36 253 295.32
Nettoinventarwert pro Aktie	349.01	322.57	284.85
Im Umlauf befindliche Aktien	79 028.00	96 525.51	127 271.53
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P USD dist- LU1732170565			
Nettovermögen	3 434 027.86	5 407 564.83	6 635 233.22
Nettoinventarwert pro Aktie	116.33	108.54	95.84
Im Umlauf befindliche Aktien	29 519.71	49 820.94	69 232.40
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -S EUR acc- LU1842717297			
Nettovermögen	1 809 977.09	1 654 075.32	1 517 445.25
Nettoinventarwert pro Aktie	166.90	150.41	137.57
Im Umlauf befindliche Aktien	10 844.68	10 997.11	11 030.35
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -S EUR dist- LU1842717370			
Nettovermögen	3 382 111.52	3 162 041.73	3 219 065.11
Nettoinventarwert pro Aktie	155.39	142.41	132.17
Im Umlauf befindliche Aktien	21 765.31	22 203.79	24 355.49
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -Y EUR dist- LU2076227706			
Nettovermögen	2 363 122.85	1 319 220.00	-
Nettoinventarwert pro Aktie	115.19	104.70	-
Im Umlauf befindliche Aktien	20 515.00	12 600.00	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -Y USD acc- LU2076228001			
Nettovermögen	73 801 003.25	87 644 244.74	65 590 956.03
Nettoinventarwert pro Aktie	155.13	142.10	124.36
Im Umlauf befindliche Aktien	475 736.50	616 778.64	527 428.08
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -Y USD dist- LU2076227961			
Nettovermögen	87 824 791.44	83 662 273.75	31 608 484.93
Nettoinventarwert pro Aktie	176.96	165.10	146.88
Im Umlauf befindliche Aktien	496 297.42	506 736.97	215 199.38
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -C EUR acc- LU0950589068			
Nettovermögen	9 313 044.48	9 446 825.84	15 074 842.94
Nettoinventarwert pro Aktie	426.44	384.52	382.73
Im Umlauf befindliche Aktien	21 839.05	24 567.84	39 387.67
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -C EUR dist- LU1732171027			
Nettovermögen	865 901.59	1 042 694.82	884 446.54
Nettoinventarwert pro Aktie	98.73	89.02	88.61
Im Umlauf befindliche Aktien	8 770.40	11 713.04	9 981.34
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -P EUR acc- LU2427701961			
Nettovermögen	17 874 468.88	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	223.82	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	79 860.91	-	-
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -P EUR dist- LU0058893917			
Nettovermögen	33 511 462.83	36 575 711.74	40 712 522.64
Nettoinventarwert pro Aktie	400.66	363.07	363.20
Im Umlauf befindliche Aktien	83 640.65	100 740.11	112 093.95

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -S EUR acc- LU1842716646			
Nettovermögen	370 904.59	333 607.98	331 261.09
Nettoinventarwert pro Aktie	116.95	105.19	104.45
Im Umlauf befindliche Aktien	3 171.48	3 171.48	3 171.48
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C CHF acc hedged- LU1111708860			
Nettovermögen	8 497 913.58	8 264 418.83	1 879 495.97
Nettoinventarwert pro Aktie	132.41	123.49	125.03
Im Umlauf befindliche Aktien	64 178.79	66 923.79	15 032.36
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C EUR acc- LU1111708787			
Nettovermögen	6 267 260.88	5 316 336.27	5 671 515.74
Nettoinventarwert pro Aktie	119.26	108.56	108.35
Im Umlauf befindliche Aktien	52 551.24	48 971.41	52 344.40
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C GBP acc hedged- LU1111709082			
Nettovermögen	439 639.52	463 753.56	863 235.48
Nettoinventarwert pro Aktie	93.62	84.12	82.86
Im Umlauf befindliche Aktien	4 696.00	5 513.00	10 418.00
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C USD acc hedged- LU1111708944			
Nettovermögen	712 420.95	2 538 702.69	3 283 592.66
Nettoinventarwert pro Aktie	170.67	153.18	149.42
Im Umlauf befindliche Aktien	4 174.26	16 573.33	21 975.59
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I CHF acc hedged- LU1111709322			
Nettovermögen	21 420 764.23	20 067 178.42	21 735 277.74
Nettoinventarwert pro Aktie	135.91	126.03	126.86
Im Umlauf befindliche Aktien	157 609.92	159 225.41	171 332.79
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I EUR acc- LU1111709249			
Nettovermögen	37 312 605.34	34 037 550.93	25 262 906.06
Nettoinventarwert pro Aktie	122.86	111.21	110.37
Im Umlauf befindliche Aktien	303 700.19	306 065.56	228 892.87
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I USD acc hedged- LU1111709595			
Nettovermögen	3 614 592.72	3 612 268.19	3 810 061.27
Nettoinventarwert pro Aktie	177.13	158.01	153.29
Im Umlauf befindliche Aktien	20 406.44	22 861.01	24 855.25
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I USD dist hedged- LU1244595754			
Nettovermögen	4 954 719.28	4 447 746.10	4 472 125.81
Nettoinventarwert pro Aktie	107.72	100.34	100.89
Im Umlauf befindliche Aktien	45 996.28	44 326.75	44 326.75
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I10 CHF acc hedged- LU2075973177			
Nettovermögen	31 981 763.10	29 640 548.49	25 804 122.26
Nettoinventarwert pro Aktie	107.78	99.89	100.51
Im Umlauf befindliche Aktien	296 731.89	296 731.89	256 731.89
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I10 EUR acc- LU2075973334			
Nettovermögen	59 861 393.48	53 192 272.26	27 353 367.10
Nettoinventarwert pro Aktie	100.39	90.82	90.10
Im Umlauf befindliche Aktien	596 288.41	585 688.97	303 588.98
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I3 CHF acc hedged- LU2075972286			
Nettovermögen	5 726 573.57	5 309 999.62	5 345 329.31
Nettoinventarwert pro Aktie	108.60	100.70	101.37
Im Umlauf befindliche Aktien	52 730.88	52 730.88	52 730.88

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 CHF acc hedged- LU1629314078			
Nettovermögen	57 996 278.75	49 151 261.26	47 033 871.13
Nettoinventarwert pro Aktie	106.17	98.35	98.91
Im Umlauf befindliche Aktien	546 258.63	499 758.63	475 521.90
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 EUR acc- LU1629313856			
Nettovermögen	135 250 721.56	109 826 126.27	80 758 247.98
Nettoinventarwert pro Aktie	110.55	99.97	99.12
Im Umlauf befindliche Aktien	1 223 434.84	1 098 590.84	814 752.30
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 EUR dist- LU1629313930			
Nettovermögen	-	-	1 880 030.90
Nettoinventarwert pro Aktie	-	-	93.14
Im Umlauf befindliche Aktien	-	-	20 185.00
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 GBP dist hedged- LU1629314581			
Nettovermögen	-	14 873.46	-
Nettoinventarwert pro Aktie	-	101.18	-
Im Umlauf befindliche Aktien	-	147.00	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 USD acc hedged- LU1629314235			
Nettovermögen	-	-	70 640.40
Nettoinventarwert pro Aktie	-	-	95.46
Im Umlauf befindliche Aktien	-	-	740.00
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 USD dist hedged- LU1629314318			
Nettovermögen	-	-	23 535 407.92
Nettoinventarwert pro Aktie	-	-	95.92
Im Umlauf befindliche Aktien	-	-	245 364.97
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ3 CHF acc hedged- LU2075975206			
Nettovermögen	7 409 014.58	9 147 805.24	20 572 047.30
Nettoinventarwert pro Aktie	104.97	97.35	98.00
Im Umlauf befindliche Aktien	70 582.21	93 968.21	209 918.85
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ3 EUR acc- LU2075975461			
Nettovermögen	2 264 804.24	4 627 935.45	4 290 790.04
Nettoinventarwert pro Aktie	109.93	99.51	98.77
Im Umlauf befindliche Aktien	20 602.24	46 507.24	43 442.24
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ3 EUR dist- LU2075975545			
Nettovermögen	6 900 724.00	6 342 942.26	6 147 072.00
Nettoinventarwert pro Aktie	94.24	89.06	92.16
Im Umlauf befindliche Aktien	73 225.00	71 221.00	66 700.00
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ10 USD acc hedged- LU2075977087			
Nettovermögen	-	6 780 340.00	6 572 195.00
Nettoinventarwert pro Aktie	-	101.96	98.83
Im Umlauf befindliche Aktien	-	66 500.00	66 500.00
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ10 CHF acc hedged- LU2075976600			
Nettovermögen	15 831 834.99	7 981 878.41	7 533 910.81
Nettoinventarwert pro Aktie	106.06	98.30	98.87
Im Umlauf befindliche Aktien	149 272.44	81 199.17	76 200.17
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ10 GBP acc hedged- LU2075977327			
Nettovermögen	1 296 066.00	1 157 328.00	1 132 932.00
Nettoinventarwert pro Aktie	113.69	101.52	99.38
Im Umlauf befindliche Aktien	11 400.00	11 400.00	11 400.00

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P CHF acc hedged- LU1111708431			
Nettovermögen	11 144 042.36	12 546 093.04	15 111 631.19
Nettoinventarwert pro Aktie	130.48	121.80	123.42
Im Umlauf befindliche Aktien	85 408.05	103 005.69	122 440.70
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P EUR acc- LU1111708357			
Nettovermögen	23 911 236.26	17 458 734.96	23 999 528.66
Nettoinventarwert pro Aktie	117.78	107.32	107.22
Im Umlauf befindliche Aktien	203 016.10	162 679.23	223 834.44
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P EUR dist- LU1210451099			
Nettovermögen	4 368 343.23	4 060 187.94	4 869 069.36
Nettoinventarwert pro Aktie	93.63	88.48	91.44
Im Umlauf befindliche Aktien	46 655.38	45 888.20	53 248.79
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P USD acc hedged- LU1111708514			
Nettovermögen	13 440 934.75	14 235 167.20	14 249 389.87
Nettoinventarwert pro Aktie	169.44	152.17	148.55
Im Umlauf befindliche Aktien	79 325.63	93 547.79	95 923.19
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P USD dist hedged- LU1244595242			
Nettovermögen	13 565 519.57	15 069 474.36	17 748 891.44
Nettoinventarwert pro Aktie	113.21	105.40	105.99
Im Umlauf befindliche Aktien	119 826.16	142 974.14	167 458.17
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C CHF acc- LU2076229074			
Nettovermögen	5 769 078.83	6 602 333.96	6 500 660.32
Nettoinventarwert pro Aktie	116.60	104.29	99.20
Im Umlauf befindliche Aktien	49 477.52	63 307.45	65 530.85
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C EUR acc- LU0950589498			
Nettovermögen	31 552 682.51	37 579 051.62	41 146 227.18
Nettoinventarwert pro Aktie	327.45	288.99	268.05
Im Umlauf befindliche Aktien	96 358.78	130 035.82	153 502.06
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C EUR dist- LU1732171373			
Nettovermögen	5 316 934.87	8 934 947.19	13 196 756.33
Nettoinventarwert pro Aktie	179.13	158.10	146.65
Im Umlauf befindliche Aktien	29 681.99	56 514.53	89 988.11
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C GBP acc- LU2076229405			
Nettovermögen	537 324.91	676 784.41	-
Nettoinventarwert pro Aktie	113.67	101.54	-
Im Umlauf befindliche Aktien	4 727.06	6 665.20	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C USD acc- LU1111703127			
Nettovermögen	9 964 741.64	11 814 297.28	14 105 993.31
Nettoinventarwert pro Aktie	140.20	125.96	111.95
Im Umlauf befindliche Aktien	71 075.19	93 794.04	126 002.62
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I EUR acc- LU0405184523			
Nettovermögen	54 235 300.19	78 831 838.32	75 381 279.41
Nettoinventarwert pro Aktie	342.54	301.88	279.62
Im Umlauf befindliche Aktien	158 332.75	261 136.34	269 584.72
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I USD (BRL hedged) acc- LU2067136072			
Nettovermögen	55 741 924.53	86 729 555.78	206 959 685.84
Nettoinventarwert pro Aktie	179.97	178.77	134.97
Im Umlauf befindliche Aktien	309 728.98	485 146.03	1 533 375.46

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I USD acc- LU1111703390			
Nettovermögen	11 529 946.44	37 421 287.46	46 413 446.65
Nettoinventarwert pro Aktie	141.15	126.62	112.40
Im Umlauf befindliche Aktien	81 685.77	295 540.10	412 931.02
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I USD dist- LU1991390706			
Nettovermögen	110 150.47	147 553.30	180 389.16
Nettoinventarwert pro Aktie	141.11	126.59	112.35
Im Umlauf befindliche Aktien	780.60	1 165.60	1 605.60
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I10 CHF acc- LU2008796604			
Nettovermögen	288 855.00	256 725.00	23 246 309.71
Nettoinventarwert pro Aktie	137.55	122.25	115.55
Im Umlauf befindliche Aktien	2 100.00	2 100.00	201 179.66
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I10 EUR acc- LU2008796273			
Nettovermögen	52 230 399.53	39 253 679.07	36 177 784.34
Nettoinventarwert pro Aktie	142.91	125.32	115.50
Im Umlauf befindliche Aktien	365 477.57	313 227.57	313 227.57
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I10 USD acc- LU2008796430			
Nettovermögen	1 916 032.70	1 667 026.72	3 934 467.85
Nettoinventarwert pro Aktie	103.96	92.80	81.95
Im Umlauf befindliche Aktien	18 430.48	17 963.65	48 010.59
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I30 CHF acc- LU2427699371			
Nettovermögen	-	5 529 263.82	23 611 442.12
Nettoinventarwert pro Aktie	-	98.70	93.24
Im Umlauf befindliche Aktien	-	56 020.91	253 232.97
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -IH1 NOK acc- LU2076230247			
Nettovermögen	-	184 783 298.05	143 574 982.38
Nettoinventarwert pro Aktie	-	1 079.90	984.44
Im Umlauf befindliche Aktien	-	171 111.49	145 844.32
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -M CHF acc- LU2499280977			
Nettovermögen	-	7 272 296.56	-
Nettoinventarwert pro Aktie	-	99.65	-
Im Umlauf befindliche Aktien	-	72 978.39	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -M EUR acc- LU0950589571			
Nettovermögen	12 622 920.00	17 025 299.20	13 174 107.50
Nettoinventarwert pro Aktie	113.72	99.20	90.95
Im Umlauf befindliche Aktien	111 000.00	171 626.00	144 850.00
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P EUR acc- LU0480508919			
Nettovermögen	163 564 229.95	151 450 740.05	155 559 343.40
Nettoinventarwert pro Aktie	310.02	274.97	256.33
Im Umlauf befindliche Aktien	527 592.51	550 790.05	606 871.39
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P EUR dist- LU0229773345			
Nettovermögen	341 705 650.00	323 866 107.08	314 026 993.39
Nettoinventarwert pro Aktie	309.69	274.68	256.06
Im Umlauf befindliche Aktien	1 103 379.67	1 179 066.94	1 226 380.51
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P SGD acc- LU2361429579			
Nettovermögen	2 071 326.66	1 344 190.00	1 452 600.00
Nettoinventarwert pro Aktie	87.70	79.07	72.63
Im Umlauf befindliche Aktien	23 618.32	17 000.00	20 000.00

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P USD acc- LU1111703473			
Nettovermögen	81 409 332.86	97 689 186.62	115 217 183.25
Nettoinventarwert pro Aktie	143.76	129.81	115.95
Im Umlauf befindliche Aktien	566 286.40	752 555.17	993 679.89
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P USD dist- LU1732171290			
Nettovermögen	4 534 990.04	5 265 302.87	15 492 629.94
Nettoinventarwert pro Aktie	136.85	123.57	110.38
Im Umlauf befindliche Aktien	33 138.40	42 609.88	140 357.22
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -S EUR dist- LU2076230833			
Nettovermögen	1 201 355.51	1 780 219.60	1 376 465.22
Nettoinventarwert pro Aktie	146.53	128.68	118.76
Im Umlauf befindliche Aktien	8 198.70	13 834.47	11 590.31
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -Y EUR acc- LU1205684001			
Nettovermögen	6 539 132.60	8 766 561.99	635 334.67
Nettoinventarwert pro Aktie	199.67	175.08	161.37
Im Umlauf befindliche Aktien	32 749.70	50 071.75	3 937.13
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -Y USD dist- LU2161043588			
Nettovermögen	42 872 270.52	60 862 449.78	54 982 275.91
Nettoinventarwert pro Aktie	104.02	92.86	81.99
Im Umlauf befindliche Aktien	412 154.11	655 421.60	670 597.34
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C CHF acc hedged- LU1073945245			
Nettovermögen	413 557.28	406 936.40	409 143.36
Nettoinventarwert pro Aktie	91.82	90.35	90.84
Im Umlauf befindliche Aktien	4 504.00	4 504.00	4 504.00
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C EUR acc hedged- LU1073945328			
Nettovermögen	3 636 872.70	5 215 904.53	4 420 221.91
Nettoinventarwert pro Aktie	98.52	94.78	94.37
Im Umlauf befindliche Aktien	36 915.07	55 031.70	46 839.27
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C EUR dist hedged- LU1244596133			
Nettovermögen	144 373.48	156 446.65	5 200 546.62
Nettoinventarwert pro Aktie	89.25	89.01	90.70
Im Umlauf befindliche Aktien	1 617.63	1 757.63	57 337.89
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C USD acc- LU1073945161			
Nettovermögen	9 057 672.20	10 133 539.89	14 007 597.68
Nettoinventarwert pro Aktie	120.20	113.52	109.87
Im Umlauf befindliche Aktien	75 355.01	89 266.56	127 492.47
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C USD dist- LU1210452063			
Nettovermögen	131 070 158.93	130 531 946.81	152 566 731.57
Nettoinventarwert pro Aktie	94.38	92.35	91.72
Im Umlauf befindliche Aktien	1 388 749.30	1 413 448.26	1 663 396.55
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -I USD acc- LU1073945591			
Nettovermögen	3 214 818.98	3 331 349.07	3 269 469.83
Nettoinventarwert pro Aktie	122.42	115.34	111.48
Im Umlauf befindliche Aktien	26 260.57	28 882.86	29 327.86
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P CHF acc hedged- LU1073944941			
Nettovermögen	4 343 470.83	4 869 108.30	6 977 831.36
Nettoinventarwert pro Aktie	79.64	78.45	79.01
Im Umlauf befindliche Aktien	54 538.81	62 066.39	88 315.80

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P EUR acc hedged- LU1073945088			
Nettovermögen	20 665 965.80	40 757 053.09	16 285 499.58
Nettoinventarwert pro Aktie	76.77	73.91	73.69
Im Umlauf befindliche Aktien	269 193.25	551 441.66	221 000.13
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P USD acc- LU1073944867			
Nettovermögen	30 832 381.26	48 117 327.13	61 011 057.45
Nettoinventarwert pro Aktie	118.92	112.42	108.91
Im Umlauf befindliche Aktien	259 269.94	428 013.94	560 197.02
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P USD dist- LU1210451842			
Nettovermögen	4 804 423.75	9 543 890.72	11 847 167.18
Nettoinventarwert pro Aktie	94.86	92.80	92.18
Im Umlauf befindliche Aktien	50 647.52	102 843.65	128 522.10
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -Y CHF acc hedged- LU1201473581			
Nettovermögen	94 146.41	92 349.45	185 048.40
Nettoinventarwert pro Aktie	92.21	90.45	90.71
Im Umlauf befindliche Aktien	1 021.00	1 021.00	2 040.00
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -Y EUR acc hedged- LU1201473664			
Nettovermögen	920 196.43	1 998 370.75	2 640 883.41
Nettoinventarwert pro Aktie	95.18	91.30	90.64
Im Umlauf befindliche Aktien	9 667.96	21 887.96	29 135.96
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -Y USD dist- LU1210452659			
Nettovermögen	74 732.00	1 028 096.55	1 480 202.41
Nettoinventarwert pro Aktie	95.20	93.15	92.53
Im Umlauf befindliche Aktien	785.00	11 037.00	15 997.00
JSS Sustainable Bond CHF -C CHF acc- LU0950591809			
Nettovermögen	3 516 692.50	3 152 398.28	2 171 724.38
Nettoinventarwert pro Aktie	152.84	146.25	145.94
Im Umlauf befindliche Aktien	23 008.98	21 554.86	14 880.94
JSS Sustainable Bond CHF -I CHF acc- LU2668234284			
Nettovermögen	4 323 093.11	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	103.16	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	41 906.68	-	-
JSS Sustainable Bond CHF -M CHF acc- LU0950591981			
Nettovermögen	1 938 151.13	2 024 938.24	1 267 904.88
Nettoinventarwert pro Aktie	98.03	93.44	92.88
Im Umlauf befindliche Aktien	19 771.00	21 671.00	13 651.00
JSS Sustainable Bond CHF -P CHF dist- LU0121751324			
Nettovermögen	9 936 526.54	15 539 561.03	16 860 241.49
Nettoinventarwert pro Aktie	146.82	140.83	140.89
Im Umlauf befindliche Aktien	67 678.29	110 342.69	119 669.54
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -C CHF acc hedged- LU2076224786			
Nettovermögen	718 173.28	944 851.78	432 101.80
Nettoinventarwert pro Aktie	83.26	82.35	87.47
Im Umlauf befindliche Aktien	8 625.67	11 473.61	4 940.00
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -C EUR acc- LU0950592104			
Nettovermögen	2 367 280.24	3 495 549.41	2 762 118.29
Nettoinventarwert pro Aktie	113.52	109.62	114.92
Im Umlauf befindliche Aktien	20 853.42	31 887.88	24 035.14

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -C EUR dist- LU1732171969			
Nettovermögen	3 514 892.18	3 661 337.73	2 344 792.31
Nettoinventarwert pro Aktie	87.60	84.59	88.68
Im Umlauf befindliche Aktien	40 124.34	43 283.34	26 441.05
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -I EUR acc- LU2076225163			
Nettovermögen	8 800 095.98	20 795 317.10	19 384 192.41
Nettoinventarwert pro Aktie	90.44	87.13	91.10
Im Umlauf befindliche Aktien	97 303.14	238 670.00	212 779.28
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -I10 EUR acc- LU2794641170			
Nettovermögen	16 347 947.77	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	99.69	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	163 987.84	-	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -I30 EUR acc- LU2783792133			
Nettovermögen	40 118 855.53	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	100.38	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	399 669.81	-	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -P CHF dist hedged- LU2076224273			
Nettovermögen	19 086 236.20	18 823 971.48	20 182 667.01
Nettoinventarwert pro Aktie	81.10	80.58	85.83
Im Umlauf befindliche Aktien	235 342.00	233 606.00	235 147.00
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -P EUR acc- LU2076223622			
Nettovermögen	10 507 805.21	9 094 426.46	-
Nettoinventarwert pro Aktie	117.70	113.94	-
Im Umlauf befindliche Aktien	89 276.17	79 817.68	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -P EUR dist- LU0158938935			
Nettovermögen	45 961 161.68	48 311 487.70	58 865 225.30
Nettoinventarwert pro Aktie	107.50	104.06	109.37
Im Umlauf befindliche Aktien	427 545.69	464 265.69	538 220.95
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -Y CHF acc hedged- LU2076226054			
Nettovermögen	188 166.00	186 142.00	12 413 559.63
Nettoinventarwert pro Aktie	85.53	84.61	89.86
Im Umlauf befindliche Aktien	2 200.00	2 200.00	138 143.33
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -Y EUR acc- LU1752454568			
Nettovermögen	61 219 169.71	9 808 052.40	7 699 267.42
Nettoinventarwert pro Aktie	96.37	92.95	97.35
Im Umlauf befindliche Aktien	635 251.32	105 519.66	79 088.52
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -Y EUR dist- LU1752454485			
Nettovermögen	2 566 200.00	2 474 700.00	2 661 120.00
Nettoinventarwert pro Aktie	85.54	82.49	86.40
Im Umlauf befindliche Aktien	30 000.00	30 000.00	30 800.00
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -C EUR acc- LU0950591718			
Nettovermögen	7 361 506.04	4 996 408.32	3 664 968.51
Nettoinventarwert pro Aktie	102.68	96.77	97.74
Im Umlauf befindliche Aktien	71 693.67	51 631.79	37 497.12
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -C EUR dist- LU1732172009			
Nettovermögen	1 159 607.58	640 385.58	505 702.00
Nettoinventarwert pro Aktie	90.22	86.33	87.19
Im Umlauf befindliche Aktien	12 853.11	7 417.88	5 800.00

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -I EUR acc- LU0734492860			
Nettovermögen	5 313 962.53	4 767 280.80	6 555 255.98
Nettoinventarwert pro Aktie	181.06	170.40	171.86
Im Umlauf befindliche Aktien	29 349.18	27 977.00	38 143.00
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -M EUR acc- LU0776582891			
Nettovermögen	3 783 116.80	3 549 867.20	5 410 762.50
Nettoinventarwert pro Aktie	189.44	177.76	178.75
Im Umlauf befindliche Aktien	19 970.00	19 970.00	30 270.00
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -P EUR dist- LU0045164786			
Nettovermögen	28 110 649.13	29 477 289.70	30 806 612.11
Nettoinventarwert pro Aktie	149.59	143.14	144.93
Im Umlauf befindliche Aktien	187 917.97	205 933.28	212 562.01
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -Y CHF dist hedged- LU2312587103			
Nettovermögen	12 727 242.18	14 767 005.76	16 456 811.98
Nettoinventarwert pro Aktie	85.41	83.77	85.71
Im Umlauf befindliche Aktien	149 013.49	176 280.36	192 005.74
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -Y EUR acc- LU1205683706			
Nettovermögen	48 733 386.63	28 402 416.03	29 956 638.77
Nettoinventarwert pro Aktie	99.25	93.40	94.19
Im Umlauf befindliche Aktien	491 016.49	304 094.39	318 044.79
JSS Sustainable Equity - Europe -C EUR acc- LU0950592369			
Nettovermögen	838 041.56	735 765.67	637 162.68
Nettoinventarwert pro Aktie	134.08	122.56	106.49
Im Umlauf befindliche Aktien	6 250.31	6 003.31	5 983.31
JSS Sustainable Equity - Europe -I EUR acc- LU1111704018			
Nettovermögen	437 063.09	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	107.94	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	4 049.13	-	-
JSS Sustainable Equity - Europe -P EUR acc- LU0484532444			
Nettovermögen	11 516 544.23	11 310 237.44	10 047 685.70
Nettoinventarwert pro Aktie	132.02	121.10	105.59
Im Umlauf befindliche Aktien	87 233.33	93 395.85	95 157.55
JSS Sustainable Equity - Europe -P EUR dist- LU0058891119			
Nettovermögen	20 674 085.50	21 063 657.74	19 866 715.55
Nettoinventarwert pro Aktie	123.02	112.84	99.89
Im Umlauf befindliche Aktien	168 054.67	186 668.36	198 885.93
JSS Sustainable Equity - Europe -P USD acc- LU1096900078			
Nettovermögen	2 647 260.32	2 508 661.32	2 483 352.94
Nettoinventarwert pro Aktie	134.48	125.57	104.91
Im Umlauf befindliche Aktien	19 685.16	19 978.19	23 671.27
JSS Sustainable Equity - Europe -Y EUR acc- LU1205683888			
Nettovermögen	9 569 788.23	2 315 855.97	3 022 775.76
Nettoinventarwert pro Aktie	137.32	124.77	107.76
Im Umlauf befindliche Aktien	69 689.69	18 561.00	28 051.00
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -C CHF acc- LU2273127774			
Nettovermögen	651 188.44	432 109.04	384 486.87
Nettoinventarwert pro Aktie	106.80	92.46	83.46
Im Umlauf befindliche Aktien	6 097.27	4 673.47	4 606.84

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -C EUR acc- LU0950592443			
Nettovermögen	2 093 862.21	1 753 613.84	2 123 919.64
Nettoinventarwert pro Aktie	272.49	232.76	204.90
Im Umlauf befindliche Aktien	7 684.18	7 534.00	10 365.64
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -C USD acc- LU1111704364			
Nettovermögen	2 781 822.50	2 702 502.39	3 097 151.02
Nettoinventarwert pro Aktie	115.04	100.02	84.38
Im Umlauf befindliche Aktien	24 181.35	27 019.62	36 704.80
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -I EUR acc- LU1111704521			
Nettovermögen	4 344 550.00	5 076 960.00	-
Nettoinventarwert pro Aktie	124.13	105.77	-
Im Umlauf befindliche Aktien	35 000.00	48 000.00	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -M CHF acc- LU2499280894			
Nettovermögen	6 214 773.06	5 324 217.93	-
Nettoinventarwert pro Aktie	120.31	103.07	-
Im Umlauf befindliche Aktien	51 656.33	51 656.33	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -M EUR acc- LU0749004452			
Nettovermögen	10 784 878.46	353 029.61	596 242.60
Nettoinventarwert pro Aktie	301.55	254.93	222.08
Im Umlauf befindliche Aktien	35 764.81	1 384.81	2 684.81
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -P EUR dist- LU0097427784			
Nettovermögen	70 672 067.21	63 920 231.29	58 991 654.58
Nettoinventarwert pro Aktie	255.91	219.69	194.37
Im Umlauf befindliche Aktien	276 159.85	290 956.49	303 501.85
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -P USD acc- LU1111704448			
Nettovermögen	5 165 617.25	9 239 321.41	8 676 821.42
Nettoinventarwert pro Aktie	183.03	159.95	135.61
Im Umlauf befindliche Aktien	28 222.79	57 763.81	63 983.64
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -C EUR acc- LU0950592872			
Nettovermögen	1 698 296.58	2 190 240.76	2 489 115.99
Nettoinventarwert pro Aktie	156.87	141.97	166.84
Im Umlauf befindliche Aktien	10 826.14	15 427.49	14 919.18
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -C EUR dist- LU1991392827			
Nettovermögen	62 611.52	57 618.24	67 710.08
Nettoinventarwert pro Aktie	83.26	76.62	90.04
Im Umlauf befindliche Aktien	752.00	752.00	752.00
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -I EUR acc- LU0950592955			
Nettovermögen	11 960 821.95	13 026 733.93	9 169 543.75
Nettoinventarwert pro Aktie	90.84	82.10	96.35
Im Umlauf befindliche Aktien	131 669.11	158 669.11	95 169.11
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -P EUR acc- LU0288928376			
Nettovermögen	12 936 457.95	13 497 169.66	16 112 652.61
Nettoinventarwert pro Aktie	148.58	135.14	159.60
Im Umlauf befindliche Aktien	87 067.29	99 875.46	100 956.47
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -P EUR dist- LU1991392074			
Nettovermögen	1 176 667.63	1 281 009.12	1 730 605.40
Nettoinventarwert pro Aktie	87.08	80.09	94.59
Im Umlauf befindliche Aktien	13 512.49	15 994.62	18 295.86

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -P USD acc- LU1111705098			
Nettovermögen	292 635.65	298 889.69	344 945.97
Nettoinventarwert pro Aktie	83.90	77.67	87.90
Im Umlauf befindliche Aktien	3 487.91	3 848.20	3 924.30
JSS Sustainable Equity - USA -C USD acc- LU0950593094			
Nettovermögen	8 936 867.17	7 131 409.63	19 671 050.72
Nettoinventarwert pro Aktie	423.94	348.32	296.42
Im Umlauf befindliche Aktien	21 080.50	20 473.73	66 362.09
JSS Sustainable Equity - USA -I EUR acc hedged- LU2729677927			
Nettovermögen	11 425 622.62	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	108.59	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	105 218.00	-	-
JSS Sustainable Equity - USA -I USD acc- LU1111705254			
Nettovermögen	-	-	6 730 755.00
Nettoinventarwert pro Aktie	-	-	154.73
Im Umlauf befindliche Aktien	-	-	43 500.00
JSS Sustainable Equity - USA -I USD dist- LU2076232961			
Nettovermögen	5 860 176.82	2 659 595.89	1 501 544.35
Nettoinventarwert pro Aktie	222.79	182.43	154.74
Im Umlauf befindliche Aktien	26 303.59	14 578.72	9 703.66
JSS Sustainable Equity - USA -I10 USD acc- LU2427700138			
Nettovermögen	86 840 354.38	34 245 334.88	32 247 671.96
Nettoinventarwert pro Aktie	122.33	100.06	84.79
Im Umlauf befindliche Aktien	709 886.00	342 248.00	380 324.00
JSS Sustainable Equity - USA -P USD acc- LU0526864581			
Nettovermögen	51 840 493.30	43 731 238.06	44 062 371.59
Nettoinventarwert pro Aktie	408.42	336.91	287.88
Im Umlauf befindliche Aktien	126 929.37	129 800.95	153 058.12
JSS Sustainable Equity - USA -P USD dist- LU2076232706			
Nettovermögen	4 185 870.51	4 198 048.30	5 803 852.37
Nettoinventarwert pro Aktie	216.12	178.28	152.34
Im Umlauf befindliche Aktien	19 368.27	23 547.50	38 098.02
JSS Sustainable Equity - USA -Y USD acc- LU1629314664			
Nettovermögen	133 830 900.59	89 059 560.07	62 056 757.37
Nettoinventarwert pro Aktie	203.76	166.41	140.78
Im Umlauf befindliche Aktien	656 806.54	535 181.54	440 806.63
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -C EUR acc- LU0950593177			
Nettovermögen	5 427 799.19	5 557 872.43	4 760 344.25
Nettoinventarwert pro Aktie	133.41	123.74	126.30
Im Umlauf befindliche Aktien	40 685.10	44 915.73	37 690.77
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -I EUR acc- LU1842720168			
Nettovermögen	18 526 950.38	16 031 565.35	-
Nettoinventarwert pro Aktie	108.34	100.11	-
Im Umlauf befindliche Aktien	171 007.48	160 139.50	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -I EUR dist- LU1842720242			
Nettovermögen	-	590 625.00	600 705.00
Nettoinventarwert pro Aktie	-	93.75	95.35
Im Umlauf befindliche Aktien	-	6 300.00	6 300.00

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -I H2 CHF dist- LU2273130562			
Nettovermögen	950 192.18	904 990.30	1 919 138.55
Nettoinventarwert pro Aktie	89.76	85.49	90.16
Im Umlauf befindliche Aktien	10 585.92	10 585.92	21 285.92
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -I USD H2 acc- LU1842720325			
Nettovermögen	-	904 266.00	892 287.00
Nettoinventarwert pro Aktie	-	91.34	90.13
Im Umlauf befindliche Aktien	-	9 900.00	9 900.00
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P CHF H2 acc- LU1111702079			
Nettovermögen	1 377 289.51	1 519 017.85	1 786 704.63
Nettoinventarwert pro Aktie	217.67	206.30	215.64
Im Umlauf befindliche Aktien	6 327.42	7 363.15	8 285.59
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P EUR acc- LU1111705338			
Nettovermögen	-	737 787.96	818 957.17
Nettoinventarwert pro Aktie	-	86.77	88.99
Im Umlauf befindliche Aktien	-	8 502.80	9 202.80
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P EUR dist- LU0058892943			
Nettovermögen	171 133 346.46	170 073 743.44	184 871 748.82
Nettoinventarwert pro Aktie	227.71	213.34	220.76
Im Umlauf befindliche Aktien	751 540.76	797 195.76	837 433.18
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P USD H2 acc- LU1842719665			
Nettovermögen	314 745.82	340 554.68	338 795.08
Nettoinventarwert pro Aktie	99.42	92.90	92.42
Im Umlauf befindliche Aktien	3 165.82	3 665.82	3 665.82
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -C CHF H2 acc- LU1111702152			
Nettovermögen	5 522 809.09	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	425.26	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	12 986.90	-	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -C CHF H2 dist- LU2273130307			
Nettovermögen	3 437 328.79	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	101.16	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	33 979.13	-	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -C USD H2 dist- LU2273130489			
Nettovermögen	10 326 244.77	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	107.73	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	95 853.01	-	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P CHF H2 dist- LU2273130133			
Nettovermögen	96 352 312.81	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	440.61	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	218 679.36	-	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C CHF H1 acc- LU1111702236			
Nettovermögen	8 183 713.34	6 167 458.39	5 832 463.75
Nettoinventarwert pro Aktie	164.28	156.71	134.63
Im Umlauf befindliche Aktien	49 815.64	39 355.87	43 322.17
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C EUR acc- LU0950593250			
Nettovermögen	25 738 439.46	23 712 542.37	23 624 828.52
Nettoinventarwert pro Aktie	328.95	301.66	258.36
Im Umlauf befindliche Aktien	78 244.23	78 606.85	91 441.51

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C EUR dist- LU1732172694			
Nettovermögen	2 378 752.03	3 159 329.37	2 789 661.05
Nettoinventarwert pro Aktie	144.93	132.90	113.82
Im Umlauf befindliche Aktien	16 413.11	23 772.23	24 509.41
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C USD acc- LU1111705684			
Nettovermögen	4 152 728.81	2 653 266.42	3 101 270.50
Nettoinventarwert pro Aktie	106.87	99.77	81.88
Im Umlauf befindliche Aktien	38 857.76	26 593.83	37 875.80
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C USD dist- LU1732172777			
Nettovermögen	1 513 049.46	1 412 462.44	1 655 188.00
Nettoinventarwert pro Aktie	106.95	99.84	81.94
Im Umlauf befindliche Aktien	14 147.26	14 147.26	20 200.00
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I CHF acc- LU1965939850			
Nettovermögen	1 345 106.12	1 633 964.70	2 712 600.41
Nettoinventarwert pro Aktie	124.00	114.56	100.02
Im Umlauf befindliche Aktien	10 847.63	14 262.96	27 120.58
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I EUR acc- LU0333595519			
Nettovermögen	9 194 873.83	12 754 794.40	5 313 032.96
Nettoinventarwert pro Aktie	337.12	307.34	261.68
Im Umlauf befindliche Aktien	27 274.78	41 500.60	20 303.55
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I EUR dist- LU1732172850			
Nettovermögen	1 371 878.94	1 404 165.29	1 069 955.60
Nettoinventarwert pro Aktie	150.32	137.04	116.68
Im Umlauf befindliche Aktien	9 126.39	10 246.39	9 170.00
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I USD acc- LU1111705411			
Nettovermögen	1 056 300.00	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	105.63	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	10 000.00	-	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I10 EUR acc- LU2427703074			
Nettovermögen	65 572 948.17	33 186 009.78	-
Nettoinventarwert pro Aktie	116.02	105.66	-
Im Umlauf befindliche Aktien	565 186.59	314 083.00	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P CHF H1 acc - LU1111702319			
Nettovermögen	11 439 839.33	11 810 865.77	10 020 107.68
Nettoinventarwert pro Aktie	158.16	151.50	130.65
Im Umlauf befindliche Aktien	72 330.80	77 959.51	76 694.28
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P EUR acc- LU0707700596			
Nettovermögen	41 078 238.56	35 820 077.13	35 663 124.35
Nettoinventarwert pro Aktie	298.82	275.13	236.58
Im Umlauf befindliche Aktien	137 468.17	130 193.28	150 744.46
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P EUR dist- LU0333595436			
Nettovermögen	143 739 699.26	139 937 199.12	123 338 485.32
Nettoinventarwert pro Aktie	298.82	275.12	236.57
Im Umlauf befindliche Aktien	481 024.36	508 640.59	521 361.48
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P GBP dist- LU1545800341			
Nettovermögen	858 032.51	791 670.68	1 148 334.81
Nettoinventarwert pro Aktie	115.86	107.96	93.13
Im Umlauf befindliche Aktien	7 405.77	7 333.00	12 330.45

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P USD H1 acc- LU1120832198			
Nettovermögen	12 651 834.43	16 041 836.75	18 671 428.20
Nettoinventarwert pro Aktie	205.64	188.62	155.07
Im Umlauf befindliche Aktien	61 524.19	85 048.44	120 406.45
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P USD dist- LU0950593417			
Nettovermögen	18 342 436.12	20 877 001.25	18 716 186.07
Nettoinventarwert pro Aktie	318.85	298.84	246.23
Im Umlauf befindliche Aktien	57 526.85	69 860.13	76 010.99
JSS Sustainable Equity - Green Planet -S EUR dist- LU1842716729			
Nettovermögen	2 159 300.62	2 847 613.90	2 511 739.92
Nettoinventarwert pro Aktie	165.83	151.54	129.33
Im Umlauf befindliche Aktien	13 021.17	18 791.17	19 421.17
JSS Sustainable Equity - Green Planet -Y EUR acc- LU1205684183			
Nettovermögen	48 799 024.36	45 080 731.49	36 103 983.78
Nettoinventarwert pro Aktie	222.39	202.42	172.07
Im Umlauf befindliche Aktien	219 429.94	222 708.88	209 821.49
JSS Bond - USD High Yield -C EUR acc hedged- LU1184841341			
Nettovermögen	1 138 793.57	2 576 987.77	2 511 983.10
Nettoinventarwert pro Aktie	120.16	112.31	108.36
Im Umlauf befindliche Aktien	9 477.31	22 945.31	23 181.83
JSS Bond - USD High Yield -C USD acc- LU1184840962			
Nettovermögen	7 724 673.98	7 510 974.83	7 446 916.19
Nettoinventarwert pro Aktie	141.61	130.10	121.77
Im Umlauf befindliche Aktien	54 548.93	57 732.32	61 155.59
JSS Bond - USD High Yield -C USD dist- LU1210450109			
Nettovermögen	9 350 821.69	9 131 830.92	8 329 069.64
Nettoinventarwert pro Aktie	97.64	94.29	92.55
Im Umlauf befindliche Aktien	95 768.35	96 848.35	89 995.35
JSS Bond - USD High Yield -I CHF acc hedged- LU1184841937			
Nettovermögen	-	-	31 310.93
Nettoinventarwert pro Aktie	-	-	101.99
Im Umlauf befindliche Aktien	-	-	307.00
JSS Bond - USD High Yield -I USD (BRL hedged) acc- LU2663598295			
Nettovermögen	1 022 336.48	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	94.00	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	10 875.92	-	-
JSS Bond - USD High Yield -I USD acc- LU1184841770			
Nettovermögen	3 285 372.65	13 120 039.31	12 510 893.72
Nettoinventarwert pro Aktie	144.86	132.77	123.97
Im Umlauf befindliche Aktien	22 679.64	98 817.80	100 918.72
JSS Bond - USD High Yield -I USD dist- LU1210450018			
Nettovermögen	418 636.27	843 411.74	6 022 295.46
Nettoinventarwert pro Aktie	97.78	94.41	92.69
Im Umlauf befindliche Aktien	4 281.41	8 933.50	64 972.44
JSS Bond - USD High Yield -P CHF acc hedged- LU1184840293			
Nettovermögen	913 435.12	866 199.31	1 434 288.04
Nettoinventarwert pro Aktie	110.11	105.69	103.29
Im Umlauf befindliche Aktien	8 295.66	8 195.66	13 886.03

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Bond - USD High Yield -P CHF dist hedged- LU1184840459			
Nettovermögen	637 019.44	658 614.16	521 028.22
Nettoinventarwert pro Aktie	78.43	79.14	81.13
Im Umlauf befindliche Aktien	8 122.14	8 322.14	6 422.14
JSS Bond - USD High Yield -P EUR acc hedged- LU1184840533			
Nettovermögen	4 297 227.30	4 435 787.55	6 263 660.91
Nettoinventarwert pro Aktie	117.18	110.05	106.42
Im Umlauf befindliche Aktien	36 672.02	40 307.02	58 857.93
JSS Bond - USD High Yield -P EUR dist hedged- LU1184840707			
Nettovermögen	2 367 213.12	2 472 941.25	2 475 807.33
Nettoinventarwert pro Aktie	82.48	81.25	82.38
Im Umlauf befindliche Aktien	28 700.45	30 436.20	30 053.50
JSS Bond - USD High Yield -P USD acc- LU1184840020			
Nettovermögen	79 236 939.06	84 364 820.97	100 186 756.41
Nettoinventarwert pro Aktie	137.78	126.96	119.19
Im Umlauf befindliche Aktien	575 097.54	664 499.22	840 563.44
JSS Bond - USD High Yield -P USD dist- LU1210449945			
Nettovermögen	56 208 609.76	60 445 051.74	65 311 068.93
Nettoinventarwert pro Aktie	95.87	90.23	92.42
Im Umlauf befindliche Aktien	586 300.30	669 899.72	706 676.79
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C CHF acc hedged- LU1332517405			
Nettovermögen	2 991 447.77	3 555 104.20	3 750 624.28
Nettoinventarwert pro Aktie	84.43	85.39	86.34
Im Umlauf befindliche Aktien	35 431.10	41 633.73	43 440.17
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C EUR acc hedged- LU1332517660			
Nettovermögen	5 955 555.36	10 639 579.77	9 225 457.32
Nettoinventarwert pro Aktie	90.23	89.18	89.12
Im Umlauf befindliche Aktien	66 004.16	119 304.55	103 517.25
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C USD acc- LU1332517231			
Nettovermögen	18 036 504.30	18 387 052.85	16 504 770.46
Nettoinventarwert pro Aktie	107.72	104.37	101.24
Im Umlauf befindliche Aktien	167 438.77	176 171.82	163 026.18
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C USD dist- LU1332517314			
Nettovermögen	1 494 812.86	1 580 747.94	1 589 095.46
Nettoinventarwert pro Aktie	92.01	89.98	92.08
Im Umlauf befindliche Aktien	16 246.20	17 567.77	17 257.77
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I CHF acc hedged- LU1332518122			
Nettovermögen	21 986 188.22	24 825 311.19	26 213 775.16
Nettoinventarwert pro Aktie	92.40	93.26	94.06
Im Umlauf befindliche Aktien	237 945.76	266 194.63	278 692.06
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I EUR acc hedged- LU1332518478			
Nettovermögen	3 160 336.97	9 619 047.89	6 615 115.18
Nettoinventarwert pro Aktie	94.43	93.07	92.86
Im Umlauf befindliche Aktien	33 467.51	103 352.83	71 237.51
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I EUR dist hedged- LU1332518551			
Nettovermögen	636 029.00	2 377 930.00	2 300 987.99
Nettoinventarwert pro Aktie	80.51	80.20	84.49
Im Umlauf befindliche Aktien	7 900.00	29 650.00	27 233.85

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I USD acc- LU1332517827			
Nettovermögen	16 732 723.04	16 388 528.09	15 478 048.47
Nettoinventarwert pro Aktie	117.59	113.72	110.10
Im Umlauf befindliche Aktien	142 297.16	144 112.98	140 581.73
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I USD dist- LU1332518049			
Nettovermögen	15 882 195.27	15 517 126.55	15 819 075.91
Nettoinventarwert pro Aktie	93.10	90.96	92.73
Im Umlauf befindliche Aktien	170 592.86	170 592.86	170 592.86
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -M CHF acc hedged- LU1332518635			
Nettovermögen	27 463 222.08	30 668 366.70	37 839 819.31
Nettoinventarwert pro Aktie	96.00	96.54	97.00
Im Umlauf befindliche Aktien	286 075.23	317 675.23	390 101.23
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P CHF acc hedged- LU1332516852			
Nettovermögen	12 792 028.98	13 795 639.77	12 696 088.30
Nettoinventarwert pro Aktie	88.67	90.04	91.18
Im Umlauf befindliche Aktien	144 265.58	153 216.79	139 242.03
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P EUR acc hedged- LU1332517074			
Nettovermögen	17 119 598.35	19 028 909.12	16 052 013.49
Nettoinventarwert pro Aktie	93.65	92.80	93.04
Im Umlauf befindliche Aktien	182 804.04	205 052.90	172 528.09
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P EUR dist hedged- LU1332517157			
Nettovermögen	4 116 868.67	4 423 604.63	3 730 320.31
Nettoinventarwert pro Aktie	79.05	80.55	82.18
Im Umlauf befindliche Aktien	52 079.30	54 917.50	45 392.07
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P USD acc- LU1332516696			
Nettovermögen	43 797 802.16	57 096 383.58	78 791 267.17
Nettoinventarwert pro Aktie	112.36	109.25	106.34
Im Umlauf befindliche Aktien	389 798.88	522 621.36	740 937.25
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P USD dist- LU1332516779			
Nettovermögen	12 886 203.68	17 158 955.32	17 255 196.29
Nettoinventarwert pro Aktie	99.51	99.41	98.22
Im Umlauf befindliche Aktien	129 496.57	172 607.94	175 679.05
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y CHF acc hedged- LU1405747244			
Nettovermögen	497 026.92	27 761 023.14	20 714 199.66
Nettoinventarwert pro Aktie	87.69	88.45	89.10
Im Umlauf befindliche Aktien	5 668.00	313 861.20	232 482.60
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y EUR acc hedged- LU1405747327			
Nettovermögen	6 021 724.40	51 530 245.89	36 066 882.05
Nettoinventarwert pro Aktie	92.67	91.30	90.92
Im Umlauf befindliche Aktien	64 980.30	564 405.76	396 688.10
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y GBP dist hedged- LU1405749539			
Nettovermögen	3 441 350.46	6 267 324.42	4 857 638.18
Nettoinventarwert pro Aktie	85.52	84.93	86.54
Im Umlauf befindliche Aktien	40 240.30	73 794.00	56 131.71
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y USD acc- LU1405747087			
Nettovermögen	14 388 575.49	16 877 619.72	16 322 190.55
Nettoinventarwert pro Aktie	108.21	104.53	101.09
Im Umlauf befindliche Aktien	132 969.00	161 461.97	161 461.97

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y USD dist- LU1405747160			
Nettovermögen	53 972 567.77	60 956 804.28	52 775 696.71
Nettoinventarwert pro Aktie	93.26	92.33	92.39
Im Umlauf befindliche Aktien	578 732.23	660 205.83	571 227.37
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -C EUR acc- LU1752455532			
Nettovermögen	2 530 608.61	2 288 119.51	2 474 888.44
Nettoinventarwert pro Aktie	159.32	133.31	111.13
Im Umlauf befindliche Aktien	15 883.81	17 163.90	22 270.21
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -C EUR dist- LU1752455615			
Nettovermögen	143 834.10	823 395.60	686 370.30
Nettoinventarwert pro Aktie	142.41	119.16	99.33
Im Umlauf befindliche Aktien	1 010.00	6 910.00	6 910.00
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -C USD acc- LU1752455375			
Nettovermögen	2 082 783.39	1 629 861.42	1 532 898.08
Nettoinventarwert pro Aktie	146.29	124.61	99.54
Im Umlauf befindliche Aktien	14 237.36	13 079.70	15 399.82
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -E EUR acc- LU2161045799			
Nettovermögen	610 232.57	511 618.77	427 326.47
Nettoinventarwert pro Aktie	134.22	112.53	93.99
Im Umlauf befindliche Aktien	4 546.51	4 546.51	4 546.51
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -E EUR dist- LU2161045872			
Nettovermögen	640 014.10	536 554.70	317 856.00
Nettoinventarwert pro Aktie	141.91	118.97	99.33
Im Umlauf befindliche Aktien	4 510.00	4 510.00	3 200.00
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -I USD acc- LU1752455888			
Nettovermögen	5 885 911.36	1 036 614.67	-
Nettoinventarwert pro Aktie	156.80	133.23	-
Im Umlauf befindliche Aktien	37 537.70	7 780.64	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P EUR acc- LU1752454998			
Nettovermögen	1 942 570.83	1 895 885.98	1 792 082.41
Nettoinventarwert pro Aktie	153.65	129.33	108.46
Im Umlauf befindliche Aktien	12 642.83	14 659.29	16 522.98
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P EUR dist- LU1752455292			
Nettovermögen	1 684 863.60	1 393 807.45	1 607 466.85
Nettoinventarwert pro Aktie	153.61	129.30	108.44
Im Umlauf befindliche Aktien	10 968.45	10 779.64	14 823.56
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P USD acc- LU1752454642			
Nettovermögen	3 627 822.42	4 444 342.14	4 914 166.14
Nettoinventarwert pro Aktie	141.04	120.85	97.12
Im Umlauf befindliche Aktien	25 721.94	36 775.69	50 598.91
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P USD dist- LU1752454725			
Nettovermögen	614 896.32	1 570 193.17	1 261 871.42
Nettoinventarwert pro Aktie	141.04	120.85	97.12
Im Umlauf befindliche Aktien	4 359.73	12 992.91	12 992.91
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -Y USD acc- LU1752456001			
Nettovermögen	22 355 502.33	23 974 611.36	-
Nettoinventarwert pro Aktie	128.81	109.28	-
Im Umlauf befindliche Aktien	173 554.09	219 387.00	-

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -Y USD dist- LU1752456266			
Nettovermögen	13 237 242.94	13 038 055.76	-
Nettoinventarwert pro Aktie	109.93	93.26	-
Im Umlauf befindliche Aktien	120 415.20	139 803.30	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C CHF acc- LU1842718345			
Nettovermögen	25 431 405.92	15 507 542.38	13 515 443.77
Nettoinventarwert pro Aktie	205.83	152.95	129.99
Im Umlauf befindliche Aktien	123 555.39	101 389.62	103 972.95
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C EUR acc- LU1752457405			
Nettovermögen	27 357 476.80	13 196 752.59	10 967 192.24
Nettoinventarwert pro Aktie	240.77	176.53	146.30
Im Umlauf befindliche Aktien	113 624.94	74 756.43	74 963.72
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C USD acc- LU1752456936			
Nettovermögen	58 384 707.46	36 082 396.35	33 724 051.97
Nettoinventarwert pro Aktie	221.05	164.98	131.03
Im Umlauf befindliche Aktien	264 124.44	218 707.70	257 376.57
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C USD dist- LU1752457157			
Nettovermögen	5 960 646.25	5 998 623.17	4 815 220.96
Nettoinventarwert pro Aktie	199.40	148.82	118.20
Im Umlauf befindliche Aktien	29 892.91	40 307.91	40 737.91
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -E USD acc- LU1842717453			
Nettovermögen	18 939 604.88	15 226 532.25	13 396 397.06
Nettoinventarwert pro Aktie	220.22	164.86	131.32
Im Umlauf befindliche Aktien	86 003.11	92 360.38	102 013.38
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -E USD dist- LU1842717537			
Nettovermögen	5 322 695.93	4 787 815.85	4 615 058.74
Nettoinventarwert pro Aktie	212.04	158.73	126.44
Im Umlauf befindliche Aktien	25 102.32	30 163.27	36 499.99
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I CHF acc- LU1842718691			
Nettovermögen	3 802 216.50	2 807 204.40	2 377 800.00
Nettoinventarwert pro Aktie	126.11	93.48	79.26
Im Umlauf befindliche Aktien	30 150.00	30 030.00	30 000.00
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I EUR acc- LU2076231567			
Nettovermögen	-	-	855 748.60
Nettoinventarwert pro Aktie	-	-	70.49
Im Umlauf befindliche Aktien	-	-	12 140.00
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I USD (BRL hedged) acc- LU1842717883			
Nettovermögen	1 744 091.23	1 538 071.83	1 959 472.42
Nettoinventarwert pro Aktie	141.40	116.73	79.55
Im Umlauf befindliche Aktien	12 334.45	13 176.32	24 631.96
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I USD acc- LU1752458551			
Nettovermögen	46 329 444.98	17 459 665.57	13 079 811.68
Nettoinventarwert pro Aktie	224.34	167.04	132.35
Im Umlauf befindliche Aktien	206 514.42	104 523.86	98 827.44
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I10 USD acc- LU2273126701			
Nettovermögen	50 628 032.85	15 337 137.50	15 743 344.68
Nettoinventarwert pro Aktie	112.60	83.75	66.29
Im Umlauf befindliche Aktien	449 627.29	183 130.00	237 492.00

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -M USD acc- LU1842718006			
Nettovermögen	180 228.60	133 286.85	11 104 438.80
Nettoinventarwert pro Aktie	205.37	151.88	129.35
Im Umlauf befindliche Aktien	877.58	877.58	85 848.00
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P CHF dist- LU1842718261			
Nettovermögen	12 676 054.29	8 629 928.98	7 738 472.33
Nettoinventarwert pro Aktie	202.71	151.53	129.55
Im Umlauf befindliche Aktien	62 532.95	56 951.95	59 733.48
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P EUR acc- LU1752456696			
Nettovermögen	24 411 431.48	12 673 238.68	22 371 819.67
Nettoinventarwert pro Aktie	232.13	171.22	142.76
Im Umlauf befindliche Aktien	105 162.76	74 017.28	156 709.30
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P EUR dist- LU1752456852			
Nettovermögen	16 927 045.24	12 703 349.94	9 791 029.54
Nettoinventarwert pro Aktie	232.14	171.23	142.77
Im Umlauf befindliche Aktien	72 917.40	74 188.81	68 579.04
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P USD acc- LU1752456340			
Nettovermögen	87 525 672.97	75 059 834.11	74 131 790.96
Nettoinventarwert pro Aktie	213.13	160.02	127.85
Im Umlauf befindliche Aktien	410 668.01	469 065.33	579 834.11
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P USD dist- LU1752456423			
Nettovermögen	13 440 005.51	11 579 457.14	11 114 120.54
Nettoinventarwert pro Aktie	213.13	160.03	127.86
Im Umlauf befindliche Aktien	63 060.13	72 358.04	86 924.14
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -Y USD acc- LU1752458049			
Nettovermögen	1 484 697.84	132 528.60	25 542 534.78
Nettoinventarwert pro Aktie	233.04	173.24	137.04
Im Umlauf befindliche Aktien	6 371.00	765.00	186 387.44
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -Y USD dist- LU1752458478			
Nettovermögen	878 643.60	665 701.05	12 493 161.28
Nettoinventarwert pro Aktie	202.92	150.85	119.31
Im Umlauf befindliche Aktien	4 330.00	4 413.00	104 711.77
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -C USD acc- LU1835934479			
Nettovermögen	3 982 785.24	7 430 564.76	8 003 106.95
Nettoinventarwert pro Aktie	85.86	86.63	80.89
Im Umlauf befindliche Aktien	46 386.97	85 778.56	98 938.15
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -C USD dist- LU1835934552			
Nettovermögen	953 649.49	1 623 048.70	1 742 427.44
Nettoinventarwert pro Aktie	69.07	73.55	72.78
Im Umlauf befindliche Aktien	13 807.00	22 065.58	23 941.02
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -I USD acc- LU1835934636			
Nettovermögen	876 800.00	880 056.00	817 400.00
Nettoinventarwert pro Aktie	87.68	88.01	81.74
Im Umlauf befindliche Aktien	10 000.00	10 000.00	10 000.00
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -I USD dist- LU1835934719			
Nettovermögen	987 230.48	1 051 689.25	1 039 924.55
Nettoinventarwert pro Aktie	69.32	73.84	73.02
Im Umlauf befindliche Aktien	14 241.64	14 241.64	14 241.64

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -M USD acc- LU1835935013			
Nettovermögen	-	262 355.87	579 420.00
Nettoinventarwert pro Aktie	-	84.63	78.30
Im Umlauf befindliche Aktien	-	3 100.00	7 400.00
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -P USD acc- LU1835934123			
Nettovermögen	3 994 087.62	5 423 704.45	5 407 189.36
Nettoinventarwert pro Aktie	83.73	84.89	79.67
Im Umlauf befindliche Aktien	47 701.99	63 888.97	67 869.83
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -P USD dist- LU1835934396			
Nettovermögen	1 611 585.62	2 625 725.79	4 079 871.85
Nettoinventarwert pro Aktie	68.83	73.26	72.47
Im Umlauf befindliche Aktien	23 414.00	35 840.84	56 297.39
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -Y USD acc- LU1835934800			
Nettovermögen	-	3 922 920.80	4 267 799.03
Nettoinventarwert pro Aktie	-	87.89	81.66
Im Umlauf befindliche Aktien	-	44 637.57	52 263.03
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -Y USD dist- LU1835934982			
Nettovermögen	446 615.06	6 164 873.11	8 244 466.78
Nettoinventarwert pro Aktie	69.13	73.63	72.84
Im Umlauf befindliche Aktien	6 460.51	83 730.82	113 185.98
JSS Equity - All China -C CHF acc- LU1965940783			
Nettovermögen	11 181 142.78	15 109 916.24	23 811 076.52
Nettoinventarwert pro Aktie	75.21	79.36	118.31
Im Umlauf befindliche Aktien	148 665.64	190 397.13	201 260.05
JSS Equity - All China -C EUR acc- LU1965940510			
Nettovermögen	13 726 598.11	17 958 609.89	27 252 201.63
Nettoinventarwert pro Aktie	85.35	88.85	129.18
Im Umlauf befindliche Aktien	160 827.16	202 122.79	210 963.01
JSS Equity - All China -C USD acc- LU1900873875			
Nettovermögen	23 565 478.98	34 293 064.85	58 570 502.44
Nettoinventarwert pro Aktie	82.00	86.89	121.07
Im Umlauf befindliche Aktien	287 383.89	394 672.17	483 773.87
JSS Equity - All China -C USD dist- LU1900873958			
Nettovermögen	3 184 588.08	3 541 367.92	4 957 300.95
Nettoinventarwert pro Aktie	82.00	86.90	121.08
Im Umlauf befindliche Aktien	38 836.44	40 752.22	40 942.36
JSS Equity - All China -I CHF acc- LU1965941161			
Nettovermögen	5 526 943.53	5 839 219.57	9 640 892.93
Nettoinventarwert pro Aktie	76.42	80.36	119.39
Im Umlauf befindliche Aktien	72 323.26	72 663.26	80 751.26
JSS Equity - All China -I EUR acc- LU1965940940			
Nettovermögen	650 325.00	1 205 464.00	1 812 004.00
Nettoinventarwert pro Aktie	86.71	89.96	130.36
Im Umlauf befindliche Aktien	7 500.00	13 400.00	13 900.00
JSS Equity - All China -I USD acc- LU1900874097			
Nettovermögen	14 968 977.08	25 964 714.16	66 245 813.95
Nettoinventarwert pro Aktie	83.32	88.00	122.18
Im Umlauf befindliche Aktien	179 656.47	295 053.57	542 198.51

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Nettoinventarwertaufstellung* (Fortsetzung)

	30.06.2024	30.06.2023	30.06.2022
JSS Equity - All China -I10 USD acc- LU2273125992			
Nettovermögen	-	21 857 198.95	30 887 097.00
Nettoinventarwert pro Aktie	-	61.17	84.85
Im Umlauf befindliche Aktien	-	357 318.93	364 020.00
JSS Equity - All China -P CHF acc- LU1965940353			
Nettovermögen	9 083 957.94	10 450 617.40	16 378 211.41
Nettoinventarwert pro Aktie	73.86	78.23	117.10
Im Umlauf befindliche Aktien	122 988.87	133 588.36	139 865.17
JSS Equity - All China -P CHF dist- LU1965940437			
Nettovermögen	1 135 290.24	1 430 313.26	2 227 678.13
Nettoinventarwert pro Aktie	73.86	78.24	117.11
Im Umlauf befindliche Aktien	15 370.84	18 281.10	19 022.10
JSS Equity - All China -P EUR acc- LU1965940197			
Nettovermögen	11 690 066.48	12 142 542.14	22 718 739.62
Nettoinventarwert pro Aktie	83.80	87.59	127.87
Im Umlauf befindliche Aktien	139 499.60	138 629.32	177 670.60
JSS Equity - All China -P USD acc- LU1900873529			
Nettovermögen	103 857 047.99	126 605 988.23	204 584 531.27
Nettoinventarwert pro Aktie	80.52	85.67	119.85
Im Umlauf befindliche Aktien	1 289 829.21	1 477 833.41	1 707 004.85
JSS Equity - All China -P USD dist- LU1900873792			
Nettovermögen	6 863 086.30	11 349 112.69	17 277 976.30
Nettoinventarwert pro Aktie	80.53	85.67	119.85
Im Umlauf befindliche Aktien	85 223.97	132 474.76	144 163.34
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus -C CHF acc- LU2611736625			
Nettovermögen	8 149 566.11	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	100.33	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	81 227.61	-	-
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus -C EUR acc- LU2611736971			
Nettovermögen	850 355.97	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	98.45	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	8 637.44	-	-
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus -C USD acc hedged- LU2611736112			
Nettovermögen	1 710 481.55	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	102.26	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	16 726.79	-	-
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus -I CHF acc- LU2611735734			
Nettovermögen	6 365 193.82	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	100.46	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	63 360.48	-	-
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus -P CHF acc- LU2611734414			
Nettovermögen	2 667 077.29	-	-
Nettoinventarwert pro Aktie	100.06	-	-
Im Umlauf befindliche Aktien	26 654.78	-	-

* Alle Beträge sind in der Währung der Anteilsklasse angegeben

Fondsperformance**/** **

Performance der Aktienklasse in % pro Kalenderjahr

	Wahrung der Aktienklasse	(31.12.2023- 30.06.2024) (laufende Berichtsperiode)	(31.12.2022- 31.12.2023)	(31.12.2021- 31.12.2022)	(31.12.2020- 31.12.2021)
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C CHF acc hedged-	CHF	-0.27	2.38	-17.20	-2.48
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C EUR acc hedged-	EUR	0.96	4.16	-16.97	-2.31
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C USD acc-	USD	1.79	6.84	-15.06	-1.37
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -C USD dist-	USD	1.79	6.87	-15.06	-1.37
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -I USD acc-	USD	1.89	7.04	-14.89	-1.17
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -I USD dist-	USD	1.88	7.02	-14.90	-1.17
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P CHF acc hedged-	CHF	-0.48	1.91	-17.59	-2.87
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P EUR acc hedged-	EUR	0.74	3.85	-17.34	-2.75
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P EUR dist hedged-	EUR	0.70	3.84	-17.35	-2.71
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P USD acc-	USD	1.55	6.36	-15.43	-1.82
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -P USD dist-	USD	1.57	6.36	-15.44	-1.81
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y CHF acc hedged-	CHF	-0.08	2.77	-16.93	-2.12
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y CHF dist hedged-	CHF	-0.13	2.73	-16.95	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y EUR acc hedged-	EUR	1.14	4.67	-16.65	-1.99
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y EUR dist hedged-	EUR	1.10	4.67	-16.67	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y GBP dist hedged-	GBP	1.77	6.34	-15.26	-
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y USD acc-	USD	1.97	7.20	-14.75	-1.03
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG -Y USD dist-	USD	1.96	7.21	-14.76	-
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -C USD acc-	USD	-0.32	3.82	-23.72	-12.16
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -C USD dist-	USD	-0.31	3.81	-23.73	-12.16
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -I USD acc-	USD	-0.18	4.11	-23.51	-
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets -P USD dist-	USD	-0.57	3.30	-24.11	-12.60
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C EUR acc-	EUR	5.53	8.30	-0.27	28.26
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C EUR dist-	EUR	5.52	8.31	-0.28	28.27
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C GBP acc-	GBP	3.26	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C USD acc-	USD	2.39	12.09	-6.41	19.22
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C USD dist-	USD	2.38	12.10	-6.41	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -C H1 GBP dist-	GBP	3.88	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -E USD acc-	USD	2.23	11.76	-6.69	18.87
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -E USD dist-	USD	2.24	11.76	-6.68	18.86
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -I USD acc-	USD	2.60	12.43	-	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -I10 EUR acc-	EUR	5.79	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -M USD acc-	USD	2.92	13.27	-	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P EUR acc-	EUR	5.27	7.76	-0.78	27.63
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P EUR dist-	EUR	5.27	7.76	-0.77	27.63
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P USD acc-	USD	2.13	11.54	-6.88	18.62
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -P USD dist-	USD	2.13	11.53	-6.87	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -S EUR acc-	EUR	5.66	8.57	-0.03	28.59
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -S EUR dist-	EUR	5.66	8.57	-0.03	28.59
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -Y EUR dist-	EUR	5.73	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -Y USD acc-	USD	2.59	12.55	-6.04	19.69
JSS Sustainable Equity - Global Dividend -Y USD dist-	USD	2.59	12.55	-6.04	19.69
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -C EUR acc-	EUR	7.19	7.69	-19.58	4.85
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -C EUR dist-	EUR	7.19	7.69	-19.58	4.85
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -P EUR acc-	EUR	6.93	-	-	-
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -P EUR dist-	EUR	6.93	7.15	-19.98	4.33
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) -S EUR acc-	EUR	7.32	7.96	-19.38	5.11
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C CHF acc hedged-	CHF	2.27	4.50	-13.14	0.69
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C EUR acc-	EUR	3.49	6.82	-12.57	1.02
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C GBP acc hedged-	GBP	4.08	8.19	-11.49	1.53
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -C USD acc hedged-	USD	4.16	8.79	-11.03	1.68
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I CHF acc hedged-	CHF	2.55	5.14	-12.68	1.18
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I EUR acc-	EUR	3.76	7.46	-12.11	1.53
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I USD acc hedged-	USD	4.43	9.50	-10.59	2.18
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I USD dist hedged-	USD	4.43	9.52	-10.50	2.29
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I10 EUR acc-	EUR	3.78	7.51	-12.07	1.74
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I3 CHF acc hedged-	CHF	2.55	5.13	-12.66	1.33

** Die Performance in der Vergangenheit ist kein zuverlassiger Hinweis auf die zukunfftige Wertentwicklung. Bei der Performanceberechnung werden allfallige bei Zeichnung und Rucknahme von Aktien erhobene Kommissionen und Kosten nicht berucksichtigt. Dividenden sind jedoch in der Performanceberechnung enthalten.
 *** Siehe Erlauterung 17.

Fondsperformance**/** (Fortsetzung)

Performance der Aktienklasse in % pro Kalenderjahr

	Wahrung der Aktienklasse	(31.12.2023- 30.06.2024) (laufende Berichtsperiode)	(31.12.2022- 31.12.2023)	(31.12.2021- 31.12.2022)	(31.12.2020- 31.12.2021)
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 CHF acc hedged-	CHF	2.60	5.24	-12.60	1.44
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I30 EUR acc-	EUR	3.80	7.56	-12.01	1.78
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ3 CHF acc hedged-	CHF	2.55	5.09	-12.67	1.34
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ3 EUR acc-	EUR	3.76	7.44	-12.10	1.69
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ3 EUR dist-	EUR	3.75	7.46	-12.11	1.69
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -I10 CHF acc hedged-	CHF	2.57	5.20	-12.18	1.38
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ10 CHF acc hedged-	CHF	2.57	5.19	-	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -IZ10 GBP acc hedged-	GBP	4.39	8.88	-	-
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P CHF acc hedged-	CHF	2.23	4.40	-13.21	0.60
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P EUR acc-	EUR	3.43	6.71	-12.65	0.93
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P EUR dist-	EUR	3.42	6.72	-12.66	0.93
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P USD acc hedged-	USD	4.10	8.73	-11.12	1.60
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond -P USD dist hedged-	USD	4.10	8.73	-11.14	1.58
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C CHF acc-	CHF	15.51	7.30	-26.39	14.70
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C EUR acc-	EUR	11.51	13.96	-22.75	19.73
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C EUR dist-	EUR	11.50	13.97	-22.76	19.74
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C GBP acc-	GBP	9.11	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -C USD acc-	USD	8.19	17.96	-27.50	11.28
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I EUR acc-	EUR	11.59	14.12	-22.65	19.90
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I USD (BRL hedged) acc-	USD	-3.77	35.87	-17.08	7.13
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I USD acc-	USD	8.27	18.13	-27.41	11.43
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I USD dist-	USD	8.27	18.13	-27.41	11.43
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I10 CHF acc-	CHF	15.88	8.00	-25.93	15.44
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I10 EUR acc-	EUR	11.87	14.70	-22.26	20.50
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -I10 USD acc-	USD	8.54	18.72	-27.05	-
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -IH1 NOK acc-	NOK	-	-	-27.05	12.52
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P EUR acc-	EUR	11.24	13.39	-23.14	19.14
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P EUR dist-	EUR	11.24	13.40	-23.14	19.14
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P SGD acc-	SGD	10.89	15.44	-28.25	*
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P USD acc-	USD	7.92	17.37	-27.86	10.72
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -P USD dist-	USD	7.93	17.36	-27.87	10.72
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -S EUR dist-	EUR	11.79	14.53	-22.36	20.33
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -Y EUR acc-	EUR	11.87	14.70	-22.26	20.50
JSS Sustainable Equity - Global Thematic -Y USD dist-	USD	8.54	18.72	-27.03	-
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C CHF acc hedged-	CHF	0.17	1.67	-8.57	-1.40
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C EUR acc hedged-	EUR	1.34	3.57	-8.29	-1.23
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C EUR dist hedged-	EUR	1.37	3.74	-8.11	-1.23
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C USD acc-	USD	2.18	6.00	-6.28	-0.29
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -C USD dist-	USD	2.18	6.01	-6.28	-0.29
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -I USD acc-	USD	2.36	6.14	-6.14	-0.17
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P CHF acc hedged-	CHF	0.11	1.52	-8.67	-1.49
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P EUR acc hedged-	EUR	1.29	3.52	-8.48	-1.34
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P USD acc-	USD	2.14	5.89	-6.37	-0.40
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -P USD dist-	USD	2.14	5.90	-6.37	-0.39
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -Y CHF acc hedged-	CHF	0.34	1.95	-8.26	-1.23
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -Y EUR acc hedged-	EUR	1.49	3.88	-8.00	-0.90
JSS Sustainable Bond - Global Short-term -Y USD dist-	USD	2.34	6.32	-6.00	-
JSS Sustainable Bond CHF -C CHF acc-	CHF	1.29	4.61	-7.96	-1.42
JSS Sustainable Bond CHF -I CHF acc-	CHF	1.37	-	-	-
JSS Sustainable Bond CHF -M CHF acc-	CHF	1.49	5.02	-7.60	-1.03
JSS Sustainable Bond CHF -P CHF dist-	CHF	1.17	4.35	-8.19	-1.67
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -C CHF acc hedged-	CHF	-2.43	3.96	-17.53	-3.26
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -C EUR acc-	EUR	-1.24	6.22	-17.07	-2.95
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -C EUR dist-	EUR	-1.24	6.21	-17.06	-2.96
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -I EUR acc-	EUR	-1.13	6.46	-16.84	-2.73
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -P CHF dist hedged-	CHF	-2.76	3.72	-17.80	-
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -P EUR acc-	EUR	-1.37	5.96	-	-

* Aufgrund der Auflegung/Auflosung der Klasse im Geschaftsjahr wurde fur diese Klasse keine Performance berechnet.

** Die Performance in der Vergangenheit ist kein zuverlassiger Hinweis auf die zukunftige Wertentwicklung. Bei der Performanceberechnung werden allfallige bei Zeichnung und Rucknahme von Aktien erhobene Kommissionen und Kosten nicht berucksichtigt. Dividenden sind jedoch in der Performanceberechnung enthalten.

*** Siehe Erlauterung 17.

Fondsperformance**/** (Fortsetzung)

Performance der Aktienklasse in % pro Kalenderjahr

	Wahrung der Aktienklasse	(31.12.2023- 30.06.2024) (laufende Berichtsperiode)	(31.12.2022- 31.12.2023)	(31.12.2021- 31.12.2022)	(31.12.2020- 31.12.2021)
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -P EUR dist-	EUR	-1.36	5.95	-17.28	-3.20
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -Y CHF acc hedged-	CHF	-2.50	3.91	-17.45	-3.14
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -Y EUR acc-	EUR	-1.17	6.32	-16.99	-2.86
JSS Sustainable Bond - Euro Broad -Y EUR dist-	EUR	-1.17	6.33	-16.99	-2.87
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -C EUR acc-	EUR	0.71	6.66	-14.98	-0.71
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -C EUR dist-	EUR	0.70	6.66	-14.98	-0.70
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -I EUR acc-	EUR	0.78	6.81	-14.86	-0.56
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -M EUR acc-	EUR	0.93	7.13	-14.61	-0.27
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -P EUR dist-	EUR	0.58	6.39	-15.19	-0.95
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -Y CHF dist hedged-	CHF	-0.48	4.55	-15.51	-
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates -Y EUR acc-	EUR	0.78	6.82	-14.85	-0.56
JSS Sustainable Equity - Europe -C EUR acc-	EUR	6.19	13.01	-11.61	20.73
JSS Sustainable Equity - Europe -I EUR acc-	EUR	6.43	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Europe -P EUR acc-	EUR	6.01	12.62	-11.93	20.31
JSS Sustainable Equity - Europe -P EUR dist-	EUR	6.01	12.62	-11.92	20.31
JSS Sustainable Equity - Europe -P USD acc-	USD	2.85	16.56	-17.34	11.82
JSS Sustainable Equity - Europe -Y EUR acc-	EUR	6.52	13.69	-11.09	21.47
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -C CHF acc-	CHF	15.95	10.10	-21.29	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -C EUR acc-	EUR	11.94	16.93	-17.41	26.15
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -C USD acc-	USD	8.61	21.01	-22.48	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -I EUR acc-	EUR	12.07	17.21	-	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -M CHF acc-	CHF	16.56	11.24	-	-
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -M EUR acc-	EUR	12.52	18.14	-16.54	27.48
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -P EUR dist-	EUR	11.66	16.35	-17.82	25.22
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 -P USD acc-	USD	8.33	20.43	-22.87	16.39
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -C EUR acc-	EUR	-0.81	7.56	-24.70	29.67
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -C EUR dist-	EUR	-0.80	7.56	-27.78	29.64
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -I EUR acc-	EUR	-0.74	7.71	-24.59	29.83
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -P EUR acc-	EUR	-1.05	7.03	-25.07	29.02
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -P EUR dist-	EUR	-1.05	7.02	-25.06	29.01
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global -P USD acc-	USD	-3.99	10.79	-29.68	19.58
JSS Sustainable Equity - USA -C USD acc-	USD	12.57	24.92	-19.00	25.36
JSS Sustainable Equity - USA -I USD dist-	USD	12.76	25.34	-18.72	25.55
JSS Sustainable Equity - USA -I10 USD acc-	USD	12.82	25.47	-	-
JSS Sustainable Equity - USA -P USD acc-	USD	12.35	24.41	-19.32	24.74
JSS Sustainable Equity - USA -P USD dist-	USD	12.35	24.41	-19.32	24.74
JSS Sustainable Equity - USA -Y USD acc-	USD	12.91	25.67	-18.51	26.12
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -C CHF H2 acc-	CHF	5.40	-	-	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -C CHF H2 dist-	CHF	5.39	-	-	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -C USD H2 dist-	USD	2.33	-	-	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -C EUR acc-	EUR	3.80	4.25	-12.01	-*
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -I EUR acc-	EUR	4.00	-	-	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -I H2 CHF dist-	CHF	5.59	0.34	-13.81	-
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P CHF H2 acc-	CHF	5.13	-0.50	-14.49	10.36
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P EUR dist-	EUR	3.55	3.77	-12.43	13.15
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P USD H2 acc-	USD	2.12	6.51	-14.42	-*
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities -P CHF H2 dist-	CHF	5.14	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C CHF H1 acc-	CHF	5.11	10.49	-21.80	26.11
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C EUR acc-	EUR	7.91	12.01	-17.43	29.96
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C EUR dist-	EUR	7.92	12.00	-17.43	29.96
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C USD acc-	USD	4.69	15.93	-22.51	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -C USD dist-	USD	4.69	15.93	-22.51	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I CHF acc-	CHF	12.12	6.09	-20.85	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I EUR acc-	EUR	8.23	12.66	-16.94	30.30
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I EUR dist-	EUR	8.22	12.67	-16.94	30.28
JSS Sustainable Equity - Green Planet -I10 EUR acc-	EUR	8.29	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P CHF H1 acc-	CHF	4.88	10.06	-22.14	25.33

* Aufgrund der Auflegung/Auflosung der Klasse im Geschaftsjahr wurde fur diese Klasse keine Performance berechnet.

** Die Performance in der Vergangenheit ist kein zuverlassiger Hinweis auf die zukunftige Wertentwicklung. Bei der Performanceberechnung werden allfallige bei Zeichnung und Rucknahme von Aktien erhobene Kommissionen und Kosten nicht berucksichtigt. Dividenden sind jedoch in der Performanceberechnung enthalten.

*** Siehe Erluterung 17.

Fondsperformance**/** (Fortsetzung)

Performance der Aktienklasse in % pro Kalenderjahr

	Wahrung der Aktienklasse	(31.12.2023- 30.06.2024) (laufende Berichtsperiode)	(31.12.2022- 31.12.2023)	(31.12.2021- 31.12.2022)	(31.12.2020- 31.12.2021)
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P EUR acc-	EUR	7.69	11.56	-17.79	29.12
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P EUR dist-	EUR	7.69	11.56	-17.79	29.12
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P GBP dist-	GBP	5.38	8.96	-13.13	-
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P USD H1 acc-	USD	6.95	15.21	-19.24	26.79
JSS Sustainable Equity - Green Planet -P USD dist-	USD	4.49	15.47	-22.85	20.01
JSS Sustainable Equity - Green Planet -S EUR dist-	EUR	8.10	12.40	-17.14	30.42
JSS Sustainable Equity - Green Planet -Y EUR acc-	EUR	8.31	12.84	-16.81	30.74
JSS Bond - USD High Yield -C EUR acc hedged-	EUR	0.67	9.96	-14.94	5.82
JSS Bond - USD High Yield -C USD acc-	USD	1.50	12.43	-12.65	6.83
JSS Bond - USD High Yield -C USD dist-	USD	1.50	12.41	-12.65	6.83
JSS Bond - USD High Yield -I USD acc-	USD	1.62	12.70	-12.45	7.09
JSS Bond - USD High Yield -I USD dist-	USD	1.62	12.69	-12.44	7.09
JSS Bond - USD High Yield -P CHF acc hedged-	CHF	-0.70	7.46	-15.30	5.26
JSS Bond - USD High Yield -P CHF dist hedged-	CHF	-0.82	7.40	-15.49	5.33
JSS Bond - USD High Yield -P EUR acc hedged-	EUR	0.46	9.49	-14.97	5.56
JSS Bond - USD High Yield -P EUR dist hedged-	EUR	0.50	9.47	-15.09	5.49
JSS Bond - USD High Yield -P USD acc-	USD	1.35	12.08	-12.91	6.51
JSS Bond - USD High Yield -P USD dist-	USD	1.35	12.09	-12.92	6.52
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C CHF acc hedged-	CHF	-3.30	2.43	-13.29	-3.36
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C EUR acc hedged-	EUR	-2.09	4.42	-12.96	-3.19
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C USD acc-	USD	-1.25	7.03	-10.84	-2.21
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -C USD dist-	USD	-1.23	7.02	-10.84	-2.21
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I CHF acc hedged-	CHF	-3.22	2.69	-13.12	-3.18
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I EUR acc hedged-	EUR	-1.97	4.70	-12.84	-3.02
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I EUR dist hedged-	EUR	-2.02	4.73	-12.76	-2.99
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I USD acc-	USD	-1.15	7.23	-10.68	-2.03
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -I USD dist-	USD	-1.16	7.22	-10.67	-2.03
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -M CHF acc hedged-	CHF	-3.02	3.08	-12.84	-2.81
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P CHF acc hedged-	CHF	-3.49	2.19	-13.56	-3.69
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P EUR acc hedged-	EUR	-2.25	4.18	-13.24	-3.54
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P EUR dist hedged-	EUR	-2.26	4.16	-13.25	-3.57
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P USD acc-	USD	-1.41	6.64	-11.14	-2.55
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -P USD dist-	USD	-1.41	6.65	-11.14	-2.56
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y CHF acc hedged-	CHF	-3.22	2.83	-13.05	-3.07
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y EUR acc hedged-	EUR	-1.98	4.85	-12.63	-2.91
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y GBP dist hedged-	GBP	-1.29	6.53	-11.37	-2.24
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y USD acc-	USD	-1.10	7.34	-10.56	-1.93
JSS Sustainable Bond - Total Return Global -Y USD dist-	USD	-1.09	7.33	-10.57	-1.92
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -C EUR acc-	EUR	16.68	20.71	-22.93	20.25
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -C EUR dist-	EUR	16.68	20.72	-	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -C USD acc-	USD	13.20	24.94	-27.66	11.75
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -E EUR acc-	EUR	16.56	20.49	-	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -E EUR dist-	EUR	16.57	20.51	-	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -I USD acc-	USD	13.34	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P EUR acc-	EUR	16.33	20.00	-23.38	19.52
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P EUR dist-	EUR	16.33	20.00	-23.38	19.51
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P USD acc-	USD	12.87	24.20	-28.10	11.09
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -P USD dist-	USD	12.87	24.20	-28.10	11.08
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -Y USD acc-	USD	13.43	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer -Y USD dist-	USD	13.44	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C CHF acc-	CHF	27.37	39.05	-37.27	19.57
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C EUR acc-	EUR	22.97	47.67	-34.17	24.81
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C USD acc-	USD	19.30	52.85	-38.22	16.00
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -C USD dist-	USD	19.30	52.85	-38.22	16.00
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -E USD acc-	USD	19.12	52.39	-38.40	15.65
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -E USD dist-	USD	19.12	52.40	-38.40	15.65
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I CHF acc-	CHF	27.53	39.38	-37.12	-

** Die Performance in der Vergangenheit ist kein zuverlassiger Hinweis auf die zukunftige Wertentwicklung. Bei der Performanceberechnung werden allfallige bei Zeichnung und Rucknahme von Aktien erhobene Kommissionen und Kosten nicht berucksichtigt. Dividenden sind jedoch in der Performanceberechnung enthalten.
*** Siehe Erlauterung 17.

Fondsperformance**/** (Fortsetzung)

Performance der Aktienklasse in % pro Kalenderjahr

	Wahrung der Aktienklasse	(31.12.2023- 30.06.2024) (laufende Berichtsperiode)	(31.12.2022- 31.12.2023)	(31.12.2021- 31.12.2022)	(31.12.2020- 31.12.2021)
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I USD (BRL hedged) acc-	USD	6.11	75.07	-29.81	-
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I USD acc-	USD	19.44	53.22	-38.08	16.28
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -I10 USD acc-	USD	19.51	53.38	-38.01	-*
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -M USD acc-	USD	19.85	54.31	-42.41	17.04
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P CHF dist-	CHF	27.00	38.21	-37.64	18.86
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P EUR acc-	EUR	22.59	46.79	-34.56	24.06
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P EUR dist-	EUR	22.60	46.78	-34.56	24.06
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P USD acc-	USD	18.95	51.94	-38.58	15.30
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -P USD dist-	USD	18.94	51.95	-38.59	15.31
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -Y USD acc-	USD	19.54	53.46	-37.97	16.44
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors -Y USD dist-	USD	19.54	53.45	-37.96	16.46
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -C USD acc-	USD	-3.43	3.87	-12.47	-10.09
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -C USD dist-	USD	-3.43	3.87	-12.47	-10.09
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -I USD acc-	USD	-3.18	4.42	-12.07	-9.79
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -I USD dist-	USD	-3.18	4.42	-12.08	-9.79
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -P USD acc-	USD	-3.67	3.37	-12.91	-10.54
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -P USD dist-	USD	-3.68	3.37	-12.91	-10.53
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -Y USD acc-	USD	-	-	-12.07	-9.73
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency -Y USD dist-	USD	-3.19	4.39	-12.07	-9.73
JSS Equity - All China -C CHF acc-	CHF	13.13	-25.24	-31.44	-11.40
JSS Equity - All China -C EUR acc-	EUR	9.21	-20.60	-28.10	-7.06
JSS Equity - All China -C USD acc-	USD	5.96	-17.81	-32.28	-14.38
JSS Equity - All China -C USD dist-	USD	5.96	-17.82	-32.28	-14.38
JSS Equity - All China -I CHF acc-	CHF	13.32	-24.98	-31.19	-11.07
JSS Equity - All China -I EUR acc-	EUR	9.40	-20.33	-27.86	-6.73
JSS Equity - All China -I USD acc-	USD	6.13	-17.52	-32.05	-14.08
JSS Equity - All China -P CHF acc-	CHF	12.92	-25.54	-31.70	-11.75
JSS Equity - All China -P CHF dist-	CHF	12.90	-25.53	-31.70	-11.75
JSS Equity - All China -P EUR acc-	EUR	8.99	-20.91	-28.39	-7.43
JSS Equity - All China -P USD acc-	USD	5.74	-18.14	-32.56	-14.73
JSS Equity - All China -P USD dist-	USD	5.75	-18.14	-32.55	-14.73
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus -C CHF acc-	CHF	0.97	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus -C EUR acc-	EUR	-2.53	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus -C USD acc hedged-	USD	2.86	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus -I CHF acc-	CHF	1.08	-	-	-
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus -P CHF acc-	CHF	0.70	-	-	-

* Aufgrund der Auflegung/Auflosung der Klasse im Geschaftsjahr wurde fur diese Klasse keine Performance berechnet.

** Die Performance in der Vergangenheit ist kein zuverlassiger Hinweis auf die zukunftige Wertentwicklung. Bei der Performanceberechnung werden allfallige bei Zeichnung und Rucknahme von Aktien erhobene Kommissionen und Kosten nicht berucksichtigt. Dividenden sind jedoch in der Performanceberechnung enthalten.

*** Siehe Erluterung 17.

Bericht der Anlageverwalter

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency

Der JSS Sustainable Bond - EM Local Currency P USD erzielte eine Rendite von -7.8%, was auf ein volatiles Umfeld für Schwellenmarktwährungen und einer Anpassung des ausgewiesenen Werts russischer Anleihen, der im Oktober 2023 auf Null gesetzt wurde, zurückzuführen war. Während des Berichtszeitraums litten die Schwellenmarktwährungen allgemein unter einem stärkeren US-Dollar, da sich das Szenario längerfristig hoher US-Zinsen durchzusetzen begann. Der hohe Carry von Währungen wie dem MXN, BRL und COP sowie der in mehreren Regionen Lateinamerikas und Asiens eingeleitete Lockerungszyklus leisteten einen positiven Beitrag zur Performance. Damit konnte die Schwäche der Schwellenmarktwährungen jedoch nur teilweise ausgeglichen werden. In der zweiten Hälfte des Berichtszeitraums verfolgten wir einen konservativen Ansatz und konzentrierten uns ausschließlich auf sehr liquide Währungen und Staatsanleihen, wobei wir osteuropäische Länder, Mexiko und Kolumbien übergewichteten. Die größten positiven Beiträge zur Performance des Fonds lieferten u. a. Argentinien, Kolumbien und Rumänien, während die größten Verluste durch die Fondspositionen in Russland und die Untergewichtung in Südafrika verursacht wurden.

JSS Bond - USD High Yield

Die Gesamrendite des JSS Bond – USD High Yield Fund P USD ACC für den 12-monatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2024 belief sich auf 8.52% und lag unter der Rendite von 10.43% des Bloomberg Barclays US Corporate High Yield 2% Issuer Capped Index (BBHY2% ICI), dem breit angelegten Wertpapiermarktindex des Fonds. Im 12-monatigen Berichtszeitraum wurde die Performance des Fonds im Vergleich zum BBHY2% ICI vor allem durch die Wertentwicklung der Anleihen und der Allokation in Aktien beeinflusst. Im Vergleich zum BBHY2% ICI wirkte sich die Sektorallokation des Portfolios in Hochzinsanleihen negativ auf den Fonds aus. Die übergewichtete Allokation des Fonds im Verpackungssektor sowie die Untergewichtung der Sektoren Einzelhandel und Banken wirkten sich negativ auf die Performance aus. Der Fonds wurde während des Berichtszeitraums auch durch seine Barbestände belastet. Im Vergleich zum BBHY2% ICI wirkte sich die Titelauswahl im Hochzinsanleihenteil des Portfolios negativ auf den Fonds aus. Dies galt insbesondere für die Sektoren Verpackungen sowie Medien und Unterhaltung. Der Fonds profitierte im Berichtszeitraum von seiner Allokation in Aktienwerten, da seine Positionen den BBHY2% ICI übertrafen. Die Aktienpositionen Vistra Corp., Dell Technologies und NRG Energy des Fonds leisteten den größten Beitrag zur Performance. Die Aktienpositionen des Fonds, die die Performance während des Berichtszeitraums am stärksten belasteten, waren O-I Glass Inc, iHeartMedia und Caesars Entertainment Inc.

JSS Equity - All China

Während des Beobachtungszeitraums erzielte der JSS Equity – All China P USD ACC Fonds eine Rendite von -6.01%, womit er hinter dem MSCI China All Shares Index zurückblieb. Während des Beobachtungszeitraums gaben chinesische Aktien im Allgemeinen nach, weil die Konjunkturerholung schwächer als erwartet ausfiel. Seit dem 4. Quartal 2023 haben wir die Positionen in Solarwerten aufgrund von Überkapazitäten in der Branche reduziert und in Upstream-Branchen wie Kupfer, Erdöl und Kohle investiert, wo die Nachfrage weiter steigt. Außerdem haben wir einige dividendenstarke Titel mit attraktiven Bewertungen aufgestockt. Dieses Kriterium erfüllen viele der oben erwähnten Upstream-Unternehmen ebenfalls. Da die internationale Expansion chinesischer Unternehmen ein langfristiger Trend ist, sehen wir darüber hinaus weiterhin Chancen bei global wachsenden Unternehmen wie Yutong Bus und Haier Smart Home.

Im Hinblick auf die Portfolioattribution trugen zyklische Konsumgüter am meisten zur Überschussrendite bei, während der IT-Sektor der größte Verlustbringer war. Auf Wertpapiererebene leisteten PDD, Yutong Bus und Zijin Mining die drei größten Beiträge, während Aiko Solar, TCL Zhonghuan und CATL die Rendite am stärksten belasteten.

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)

Während des Beobachtungszeitraums lag die Rendite des JSS Sustainable Multi Asset – Thematic Balanced (EUR) P EUR dist Fonds bei 10.35%. Im 12-monatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2024 blieb der Fonds leicht hinter seiner Benchmark zurück, was überwiegend auf nachteilige Effekte bei der Titelauswahl zurückzuführen ist. Der Finanzsektor erwies sich als deutliche Belastung für die Performance. Alphabet, Amazon und ASML hingegen lieferten die wichtigsten positiven Beiträge. Sie profitierten vom anhaltenden Wachstum im KI-Sektor und nutzten ihre innovativen Lösungen und starken Marktpositionen. Dagegen belasteten Meta, AIA und Reckitt die Performance des Fonds, wobei AIA die allgemeine Schwäche der Finanzwerte widerspiegelte. Der Ausschluss von Meta aus dem Portfolio trotz des anhaltenden KI-Wachstums belastete die Rendite erheblich. Strategisch richtete der Fonds Positionen in Nvidia und Zoetis ein. Nvidia treibt an der Spitze der Halbleiterindustrie den KI-Trend voran und Zoetis spielt weiterhin eine führende Rolle im globalen Tiergesundheitsgeschäft. Im Laufe des Jahres verringerten wir unser Engagement in Anleihen, um eine Übergewichtung von Aktien zu finanzieren. Dieses Vorgehen führte zu einem positiven Effekt der Vermögensallokation, der die negativen Auswirkungen der Titelauswahl teilweise ausglich. Im Rentenbereich wirkte sich die Bevorzugung von Unternehmensanleihen gegenüber Staatsanleihen positiv aus. Die Lage im 3. Quartal 2023 war zwar nicht einfach, dennoch begann die Strategie des Fonds, in thematische Sektoren zu investieren und gleichzeitig einen ausgewogenen Ansatz gegenüber anderen Anlageklassen beizubehalten, in der zweiten Hälfte des Berichtszeitraums positive Ergebnisse zu erzielen.

JSS Sustainable Bond - Global Short-Term

Während des Berichtszeitraums erzielte der JSS Sustainable Bond – Global Short Term IG P USD in einem volatilen Umfeld für Zinsen und festverzinsliche Anlagen eine Rendite von 5.8%. Die Renditen entwickelten sich in den ersten vier Monaten des Berichtszeitraums recht langsam: Die Verzinsung 2-jähriger US-Staatsanleihen stieg um 30 Basispunkte auf rund 5,2%. Die hartnäckigere Inflation in den USA löste dann eine Neubewertung der USD-Zinsstrukturkurve aus. Daraufhin reduzierten die Marktteilnehmer ihre Erwartungen bezüglich des Timings und der Anzahl der für das Jahr zu erwartenden Zinssenkungen der Fed. Im weiteren Jahresverlauf verbesserte sich die Performance aber vor allem aufgrund von zwei wesentlichen Elementen, allerdings mit einer gewissen Volatilität. Die US-Zinsen waren im Durchschnitt moderat rückläufig, nachdem die Inflation in den USA allmählich an Dynamik verlor. Und noch wichtiger war die erhebliche Verengung der EM-Spreads (-50 Basispunkte im IG-Segment und -120 Basispunkte im HY-Segment), unterstützt durch den begrenzten Bestand verfügbarer EM-Anleihen nach zwei Jahren mit schwacher Neuemissionsaktivität und einer relativen Untergewichtung von risikoreicheren Anleihen vor dem 4. Quartal 2023. Wir starteten sehr vorsichtig in den Berichtszeitraum mit einem Schwerpunkt auf qualitativ hochwertigen Schwellenmarktanleihen, wobei wir 1.) die hohen Finanzierungskosten für Emittenten, 2.) die Risiken geopolitischer Instabilität in einigen Regionen (Nahe Osten) und 3.) regionsübergreifende Unwägbarkeiten im Zusammenhang mit dem Ausgang mehrerer politischer Wahlen berücksichtigten. Wir erhöhten opportunistisch das Engagement in neuen vorrangigen Anleihen von hoher Qualität (MREL) osteuropäischer Banken, die attraktive Spreads boten. Wir erhöhten auch das Engagement in Schuldtiteln, die sich etwas schwächer entwickelten. Angesichts ihrer Fundamentaldaten und dem von ihnen gebotenen Spread-Puffer sind wir mit ihnen weiterhin zufrieden.

Bericht der Anlageverwalter (Fortsetzung)

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG

Während des Berichtszeitraums erzielte der JSS Sustainable Bond – Global Emerging Markets Corporate IG P USD in einem volatilen Umfeld für Zinsen und festverzinsliche Anlagen eine Rendite von 5.8%. Im Allgemeinen lagen die Renditen in den ersten vier Monaten des Berichtszeitraums im negativen Bereich: Die Verzinsung 5- bis 10-jähriger US-Staatsanleihen stieg um 100 Basispunkte auf rund 5%. Die hartnäckigere Inflation in den USA löste dann eine Neubewertung der USD-Zinsstrukturkurve aus. Daraufhin reduzierten die Marktteilnehmer ihre Erwartungen bezüglich des Timings und der Anzahl der für das Jahr zu erwartenden Zinssenkungen der Fed. Im weiteren Jahresverlauf erholte sich die Performance aber vor allem aufgrund von zwei wesentlichen Elementen, allerdings mit einer gewissen Volatilität. Die US-Zinsen waren im Durchschnitt moderat rückläufig, nachdem die Inflation in den USA allmählich an Dynamik verlor. Und noch wichtiger war die erhebliche Verengung der EM-Spreads (-50 Basispunkte im IG-Segment und -120 Basispunkte im HY-Segment), unterstützt durch den begrenzten Bestand verfügbarer EM-Anleihen nach zwei Jahren mit schwacher Neuemissionsaktivität und einer relativen Untergewichtung von risikoreicheren Anleihen vor dem 4. Quartal 2023. Wir starteten sehr vorsichtig in den Berichtszeitraum mit einem Schwerpunkt auf qualitativ hochwertigen Schwellenmarktanleihen, wobei wir 1.) die hohen Finanzierungskosten für Emittenten, 2.) die Risiken geopolitischer Instabilität in einigen Regionen (Naher Osten) und 3.) regionsübergreifende Unwägbarkeiten im Zusammenhang mit dem Ausgang mehrerer politischer Wahlen berücksichtigten. Wir erhöhten opportunistisch das Engagement in neuen vorrangigen Anleihen von hoher Qualität (MREL) osteuropäischer Banken, die attraktive Spreads boten. Wir erhöhten das Engagement in Schultiteln, die sich etwas schwächer entwickelten. Angesichts ihrer Fundamentaldaten und dem von ihnen gebotenen Spread-Puffer sind wir mit ihnen weiterhin zufrieden.

JSS Sustainable Bond - EUR Corporates

Während des Berichtszeitraums erzielte die Anteilsklasse JSS Sustainable Bond - EUR Corporates P EUR dist eine absolute Rendite von 5.84%. Die Duration des Fonds wurde im Berichtszeitraum aktiv verändert. Die Zinssätze sanken im letzten Quartal 2023 aufgrund einer weltweiten Verbesserung der Inflationslage und der Erwartung erster Zinssenkungen durch die Notenbanken deutlich. Auch bei den Kreditspreads gab es erhebliche Bewegungen, insbesondere als der politische Richtungswechsel der Zentralbanken an den Märkten eingepreist wurde, während die Wirtschaftsleistungen robust blieben. Im Berichtszeitraum war die absolute Wertentwicklung somit positiv.

Die Performancetreiber des Fonds im Berichtszeitraum waren:

- Duration: Negative Bruttoperformance im Vergleich zur Benchmark
- Allokation: Positive Bruttoperformance im Vergleich zur Benchmark
- Auswahl: Positive Bruttoperformance im Vergleich zur Benchmark

JSS Sustainable Bond - Total Return Global

Während des Berichtszeitraums erzielte die Anteilsklasse JSS Sustainable Bond - Total Return Global P USD acc eine absolute Rendite von 2.85%. Robuste US-Wirtschaftsdaten und Sorgen über langfristigen Inflationsdruck drückten die Zinsen aufwärts. Beflügelt von soliden Gewinnen und günstigen technischen Faktoren haben sich die Spreads von Unternehmensanleihen weiter verengt. Vor diesem Hintergrund konnten der starke Carry und der positive Beitrag unserer Unternehmensanleihen die negativen Auswirkungen steigender Zinsen mehr als ausgleichen. Die Zentralbanken in den Schwellenländern konnten ihre Zinssätze mehrmals senken, was danach auch in einigen Industrieländern gelang. Dies führte zu einer Outperformance unserer Staatsanleihen aus Schwellenländern in lokaler Währung (Mexiko, Polen). Kürzlich profitierten wir von der Versteilerung der Zinsstrukturkurve in den USA und teilweise auch in Europa, dank der größeren Wahrscheinlichkeit einer ersten Zinssenkung durch die Fed und dem wachsenden Vorsprung von Donald Trump in den Wahlprognosen. Im Vorfeld der US-Wahlen bevorzugten wir Kurven von Ländern mit einer soliden Haushaltsdisziplin (AUD, NOK, GER) und weniger ausgeprägten Zinssenkungserwartungen (AUD, NOK).

JSS Sustainable Bond CHF

JSS Sustainable Bond CHF P CHF dist erzielte während des Berichtszeitraums eine Rendite von 4.25%. Die Duration des Fonds war zu Beginn des Berichtszeitraums weiterhin neutral gewichtet. Im Oktober 2023 erhöhten wir sie auf eine Übergewichtung. Dies wirkte sich positiv auf die Performance im letzten Quartal 2023 und im ersten Halbjahr 2024 aus. Die Schweizerische Nationalbank (SNB) senkte ihren Leitzins im März 2024 auf 1.50% und im Juni 2024 erneut auf 1.25%. Dies führte zu einer starken Abflachung der Zinsstrukturkurve, die Inversion blieb jedoch bestehen. Auf das Portfolio hatte es keinen wesentlichen Einfluss. Ab September 2023 stiegen die Kreditspreads deutlich an. Der Fonds wurde davon nur teilweise beeinträchtigt. Die Übergewichtung von Unternehmensanleihen leistete einen positiven Beitrag, während die Untergewichtung von Finanztiteln einen negativen Einfluss hatte.

Die Performancetreiber des Fonds im Berichtszeitraum waren:

- Duration: Positive Performance im Vergleich zur Benchmark
- Positionierung entlang der Renditekurve: Kein wesentlicher Einfluss auf die Performance
- Allokation: Negative Performance im Vergleich zur Benchmark
- Auswahl: Positive Performance im Vergleich zur Benchmark

JSS Sustainable Bond EUR Broad

Im Berichtszeitraum erzielte die Anteilsklasse JSS Sustainable Bond EUR Broad P EUR dist eine absolute Rendite von 3.31%. Die Duration des Fonds wurde im Berichtszeitraum aktiv verändert. Im Durchschnitt wurde er jedoch während des gesamten Berichtszeitraums länger als die Benchmark gehalten. Die Zinssätze kletterten auf einen Höchststand im zweiten Halbjahr 2023 und sanken danach wieder stark aufgrund des Endes der Zinserhöhungszyklen. Im ersten Halbjahr 2024 zogen die Zinsen jedoch gegenüber den Niveaus von Ende 2023 wieder an. Bei den Kreditspreads setzte sich der Verengungstrend fort. Im Berichtszeitraum war die absolute Wertentwicklung positiv.

Die Performancetreiber des Fonds im Berichtszeitraum waren:

- Duration: Die aktive Steuerung der Duration lieferte eine positive Bruttoperformance im Vergleich zur Benchmark.
- Allokation: Unsere Übergewichtung von Finanztiteln gegenüber Nicht-Finanztiteln und staatsnahen Anleihen gegenüber Staatsanleihen führte zu einer positiven Bruttoperformance im Vergleich zur Benchmark.
- Auswahl: Die Auswahl von Emittenten und Instrumenten hatte ebenfalls einen positiven Bruttoperformanceeffekt im Vergleich zur Benchmark.

JSS Sustainable Equity – Next-Gen Consumer

Während des Berichtszeitraums erzielte die Anteilsklasse JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer P USD acc eine absolute Rendite von 16.71%. Der Fonds erzielte während des Berichtszeitraums eine starke positive Performance. Die starke Portfoliogewichtung von Unternehmen aus dem Sektor zyklische Konsumgüter leistete einen positiven Beitrag, ebenso wie das Engagement in Medien, Unterhaltung und Unterhaltungselektronik. Im Sektor zyklische Konsumgüter profitierte der Fonds von einer sehr starken Performance u.a. in den Bereichen E-Commerce, Sportbekleidung, Reise- und Gastronomie. Dem Fonds kam außerdem die starke Performance digitaler Werbeplattformen zusammen mit Musikinhalten zugute. Und schließlich leistete Nvidia einen starken Beitrag. Die Performance wurde durch das Engagement in Basiskonsumgütern etwas beeinträchtigt, da die Sektoren Nahrungsmittel und Getränke schwach abschnitten.

Bericht der Anlageverwalter (Fortsetzung)

JSS Sustainable Equity – Europe

Während des Berichtszeitraums erzielte der JSS Sustainable Equity – Europe P EUR dist eine Gesamttrendite von 9.02% und blieb damit hinter dem MSCI Europe Net Return zurück. In einem Umfeld, das für Banken vorteilhafter war, führte unsere Positionierung in qualitativ hochwertigeren, aber weniger zinssensitiven Banken zu einer Underperformance, ebenso wie unsere Untergewichtung von Bergbauunternehmen. Wir sind uns bewusst, dass es bei Titeln mit geringer Qualität gelegentlich zu einer Neubewertung kommt, die zu hohen kurzfristigen Renditen führt. Allerdings zeigt die Erfahrung auch deutlich, dass es in vielen dieser Fälle zu einer Mean-Reversion kommt. Wir halten daher an unserer Positionierung in Titeln mit niedrigerer Hebelung, die unserer Ansicht höhere Qualität bieten, fest.

Wir konzentrieren unsere Anstrengungen weiterhin auf die Auswahl von Unternehmen, die eine hohe Barrendite auf ihr Kapital in Verbindung mit einem realistischen Wachstumspfad aufweisen. Wir suchen Managementteams mit guten Kapitalallokationsfähigkeiten und behalten den Preis im Auge, den wir für diese Unternehmen zahlen. Da unsere Positionen ihre Gewinne mit hohen Renditen aufzinsen, tendieren die Marktwerte dazu, dies zu erkennen. Genau diese langfristige Einschätzung ermöglicht es uns, von unseren Fundamentalresearch-Bemühungen zu profitieren.

JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035

Der JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 P EUR dist erzielte während des Berichtszeitraums eine Performance von 16.49%. Der Klimawandel ist nach wie vor eine Herausforderung, die von uns verlangt, jetzt Maßnahmen zu ergreifen, um eine weitere globale Erwärmung zu vermeiden. Im Kern besteht die Notwendigkeit, die Kohlenstoffemissionen zu reduzieren. Die Strategie bevorzugt Unternehmen, die ihre eigenen CO2-Emissionen senken, und Unternehmen, die neue Lösungen anbieten, die anderen dabei helfen können, CO2-neutral zu werden, während gleichzeitig Stranded Assets wie fossile Brennstoffe vermieden werden. Im Berichtszeitraum lag die Bruttoperformance des Fonds leicht unter der Benchmark, was vor allem auf die negative Titelauswahl zurückzuführen war. Unsere Branchenallokation wirkte sich wegen ihrer strukturellen Untergewichtung im Energiesektor leicht negativ auf die Performance aus. Unsere Stillallokation leistete aufgrund unserer Ausrichtung auf Aktien mit höherem Momentum einen leicht positiven Performancebeitrag. Der unvermindert hohe Enthusiasmus für Technologiewerte und insbesondere Aktien aus dem KI-Bereich trieb die Aktienkurse einer sehr kleinen Gruppe von Unternehmen in die Höhe. Unsere untergewichtete Positionierung bei einigen dieser Titel war ungünstig für unsere Titelauswahl. Wir halten an unserer Strategie fest, die am besten positionierten Titel für eine Welt mit geringerem CO2-Ausstoß zu finden, da bedeutende neue Investitionen weiterhin in Geschäftsfelder geleitet werden dürften, die den globalen Treibhausgasausstoß verringern können.

JSS Sustainable Equity - Global Dividend

Der JSS Sustainable Equity - Global Dividend P USD acc erzielte während des Berichtszeitraums eine Performance von 8.2%. Die wichtigsten Änderungen bei der Sektorallokation waren der Ausbau unserer Allokation auf Informationstechnologie und die entsprechende Reduzierung von zyklischen Konsumgütern und Finanzen. Die höhere Allokation in Informationstechnologie ist auf die Aufnahme von Microchip Technology und Broadcom zurückzuführen, die den Verkauf von TE Connectivity mehr als ausglich. Im Finanzsektor verkauften wir PNC Financial Group. Bei zyklischen Konsumgütern reduzierten wir Inditex und nahmen Gewinne mit. Der Fonds konzentrierte sich weiterhin auf Unternehmen mit starken Bilanzen (niedriger Verschuldungsgrad), guten operativen Cashflows und attraktiver Dividendenperspektive. Die Marktführung ist jedoch weiterhin auf eine kleine Anzahl von US-Wachstumsunternehmen mit erheblichem Engagement in KI konzentriert, was für unsere Strategie im Vergleich zum breiteren Markt abträglich war. Diese Unternehmen sind aus Dividendensicht nicht attraktiv und werden daher nicht in unserer Strategie berücksichtigt. Grundsätzlich übertrafen die meisten unserer Unternehmen die Gewinnerwartungen und steigerten ihre Dividendenausschüttungen weiter.

JSS Sustainable Equity - Global Thematic

Die Anteilsklasse JSS Sustainable Equity – Global Multifactor P EUR dist erzielte während des Berichtszeitraums auf absoluter Basis eine Performance von 12.75%. Der größte Belastungsfaktor für die relative Rendite war die Titelauswahl, insbesondere in den Sektoren Finanzen, Gesundheitswesen und Industrie. Die makroökonomische Schwäche Chinas wirkte sich in einer Reihe von Bereichen auf das Portfolio aus, insbesondere im Finanzsektor. Die asiatischen Lebensversicherer AIA und Prudential belasteten die Performance aufgrund der schlechten Stimmung unter Verbrauchern und Anlegern am stärksten und verringerten die relative Performance des Fonds um 1.8%. Wir haben inzwischen unsere Position in AIA verkauft und unsere Positionen in einer Reihe anderer in China engagierter Unternehmen wie Tencent und Daikin reduziert. Obwohl die untergewichtete Position in Nvidia gegenüber der Benchmark bei absoluter Betrachtung einen der höchsten Beiträge zur Performance leistete, kostete sie den Fonds in Bezug auf die relative Performance mehr als 1%. Die Titelauswahl im Sektor zyklische Konsumgüter war positiv, angeführt von einer starken Übergewichtung von Amazon, die im Berichtszeitraum eine Rendite von 45% erzielte, da die Anleger hinsichtlich der Margen im E-Commerce-Geschäft und des Potenzials für einen Nachfrageschub im Cloud-Computing-Geschäft Amazon Web Services durch KI optimistischer wurden. Die Marktrenditen werden weiterhin von einer kleinen Anzahl von Unternehmen dominiert, und das Managementteam des Fonds behält die Dynamik und die Bewertungen dieser großen Unternehmen im Blick.

JSS Sustainable Equity - Green Planet

Der JSS Sustainable Equity - Green Planet Fund P EUR dist erzielte in den 12 Monaten zum 30. Juni 2024 eine Rendite von 8.61%. Performancetreiber des Teilfonds waren Industrieunternehmen in den Bereichen Abfallmanagement, Wassertechnologie und Umweltberatung. Im Technologiesektor leistete auch das Engagement in Software einen positiven Beitrag zur Performance. Clean Tech blieb ein schwacher Punkt im grünen Investmentbereich, da hohe Zinsen, Lieferketten- und Kostenprobleme den Sektor unter Druck setzten. Die positive Titel- und Branchenauswahl waren besonders zuträglich für die jährliche Rendite, auch aufgrund des begrenzten Engagements des Fonds im schwächer werdenden Clean-Tech-Sektor. Während des Berichtszeitraums stockte der Fonds das Thema Elektrifizierung auf, da die steigende Nachfrage nach Elektrizität, insbesondere durch Rechenzentren, Digitalisierung und das Laden von Elektrofahrzeugen, die Investitionen in Netzwerke und Energieeffizienz beschleunigt. Außerdem wurde das Engagement im Abfallmanagement aufgestockt, das von einem strukturellen Wachstumstrend im Zusammenhang mit strengerer Kreislaufwirtschaftsregulierung und positiver Preissetzungsmacht profitiert.

JSS Sustainable Equity - Real Estate Global

Während des Berichtszeitraums erzielte der JSS Sustainable Equity - Real Estate Global P EUR acc eine Performance auf absoluter Basis von 9.95%. Aufbauend auf der Entwicklung im Vorjahr entwickelten sich unsere Anlagen im Industriesektor, wo wir im Vergleich zur Benchmark übergewichtet waren, positiv. In der ersten Hälfte des Berichtszeitraums entwickelten sich zinssensitive REITs gut. Da die Anleger jedoch aufhörten, mehrere Zinssenkungen einzupreisen, belasteten diese Positionen – insbesondere im deutschen Wohnimmobiliensektor – die Performance. Der Fonds profitierte von dem erhöhten Engagement in japanischen REITs, darunter Nippon Prologis, da die Inflation in der Region zu steigen begann, was das Interesse der Anleger wiederbelebte. Wir richteten auch eine Position im Ventas REIT mit Sitz in den USA ein, der im Sektor für Seniorenwohnungen und im Gesundheitswesen tätig ist. Leider führte die anhaltende Schwäche der chinesischen Wirtschaft dazu, dass unser Engagement in REITs mit Sitz in Hongkong der Performance abträglich war. Darüber hinaus belasteten Positionen in zinssensitiven Aktien die Performance ebenfalls.

Bericht der Anlageverwalter (Fortsetzung)

JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets

Die Anteilsklasse JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets P USD dist erzielte während des Berichtszeitraums eine absolute Rendite von 0.02%. Von Juni 2023 bis Juni 2024 war die Positionierung der Strategie auf Wachstum, Qualität und Momentum ausgerichtet und in das JSS-Universum mit A-Rating investiert. Während des Berichtszeitraums verharrten die Zinssätze weltweit überwiegend auf hohem Niveau, verursacht von der anhaltenden Inflation in den wichtigsten Ländern. Geopolitische Spannungen aufgrund von Kriegen und Handelsstreitigkeiten erhöhten die Unsicherheit an den globalen Märkten. Das Vertrauen der Anleger und Verbraucher in die chinesische Wirtschaft war angesichts des Trends in der globalen Handelspolitik und der enttäuschenden binnenpolitischen Maßnahmen sowohl im Immobiliensektor als auch im Privatsektor schwach. Die Strategie hat asiatische Länder übergewichtet und Mexiko untergewichtet. Die Länderallokation leistete einen positiven Beitrag, die Auswahl innerhalb der Länder war abträglich. Die negative Auswahl in China zeigte sich vor allem in den Sektoren zyklische Konsumgüter und Finanzen. Die Auswahl in südkoreanischen Grundstoffunternehmen wurde durch das JSS-Rating bestimmt und leistete ebenfalls einen deutlich negativen Beitrag zur Performance. ESG-Ausschlüsse waren im Berichtszeitraum insgesamt ungünstig für die Performance.

JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors

In den 12 Monaten zum 30. Juni 2024 erzielte die Anteilsklasse JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors P USD acc eine Rendite von 33.2%. Die Performance des Teilfonds wurde durch die Übergewichtung von Halbleitern, Software und Kommunikationsdiensten bestimmt. Darüber hinaus trug die starke Titelauswahl in diesen Branchen zur Performance in diesen Sektoren bei. Im letzten Jahr erhöhten wir unser Engagement in Unterthemen (wie Edge-KI), blieben aber bei Halbleitern und Software selektiv. Dagegen hielten wir uns bei wachstumsstarken/unrentablen Software- und Internetunternehmen weiterhin zurück.

JSS Sustainable Equity – USA

Während des Berichtszeitraums erzielte die Anteilsklasse JSS Sustainable Equity - USA P USD acc eine absolute Rendite von 21.23%. Nach einem guten Ende des Jahres 2023 setzten die US-Aktien ihren Höhenflug im ersten Halbjahr 2024 fort. Ein unvermindert hoher Enthusiasmus für Technologie und insbesondere künstliche Intelligenz trieb die Märkte in die Höhe, wobei die Führung auf einen kleinen Kreis von Unternehmen begrenzt war. Wie schon in den vergangenen Jahren haben wir die Stilengagements im Fonds mit großer Sorgfalt verwaltet, hatten mit unserer Titelauswahl jedoch größere Schwierigkeiten bei der Alpha-Generierung als üblich. Während des Berichtszeitraums lag die Bruttoperformance des Fonds leicht unter derjenigen der Benchmark. Der JSS Sustainable Equity - USA profitierte von einer positiven Branchen- und Stilallokation, während die Titelauswahl zurückblieb und für die Underperformance verantwortlich ist. Wie so oft bleibt der makroökonomische Ausblick unsicher. Umso mehr sind wir bestrebt, ein ausgewogenes Portfolio zu halten und dabei unsere Anlagegrundsätze zu beachten, die auf Qualität, Dynamik, Bewertung und Nachhaltigkeit beruhen.

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities

Im Berichtszeitraum erzielte die Anteilsklasse JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities P EUR dist eine absolute Performance von 7.3%. Unser internes Zyklusmodell zeigte während des gesamten Berichtszeitraums die „mittlere“ Phase als vorherrschendes Marktumfeld an. Die Strategie begann mit einer eher vorsichtigen Aktienpositionierung, die in Folge der Verbesserung des fundamentalen Ausblicks für die Wirtschaft gegen Ende 2023 aufgestockt wurde. Außerdem hielt das Aktiensegment der Strategie während des gesamten Berichtszeitraums entsprechend der Positionierung in der „mittleren“ Phase eine Allokation von 30 % in Value-Titeln, 20 % in Qualitätsaktien und 50 % in Momentum-Titeln bei. Diese Allokationsstrategie stimmte mit der relativen Wertentwicklung der Faktoren im Berichtszeitraum überein, da Momentum und Value die defensiven Faktoren wie Quality und Low Volatility deutlich übertrafen. Aufgrund der gleichgewichteten Umsetzung behielt die Strategie jedoch untergewichtete Positionen in Mega-Cap-Aktien wie Nvidia, Amazon und Meta bei, die eine starke Outperformance aufwiesen und die Performance der Strategie im Berichtszeitraum stark belasteten. Positive Performanceeffekte resultierten aus der Anleiheauswahl, da die Beeinträchtigung durch Staatsanleihen mit langer Duration durch die Ausrichtung der Strategie auf eine niedrige Duration mehr als ausgeglichen wurde.

JSS Twelve Sustainable Insurance Bond

Während des Berichtszeitraums erzielte die Anteilsklasse JSS Twelve Sustainable Insurance Bond Opp P EUR acc eine absolute Performance von 9.75%. Das Jahr 2023 wurde hauptsächlich von den Erwartungen des Marktes geprägt, dass die Zinssätze die Höchststände überschritten hätten, was mit einer Reihe schwächerer Inflationsdaten aus den westlichen Volkswirtschaften begründet wurde. Darüber hinaus gehörte die Fed zu den ersten Zentralbanken, die eine neue Richtung in den Kommentaren zu weiteren Zinserhöhungen und einer deutlichen Abkehr von der bisherigen Haltung anschlug. Das löste eine breite Rally über alle Anlageklassen hinweg aus, angeführt von Staatsanleihen und gefolgt von allen anderen Anlageklassen. Dies kam auch Versicherungsanleihen zugute, und viele Neuemissionen zogen preislich schnell an. Anleihen mit längerer Duration entwickelten sich gut, da die zugrunde liegenden Zinssätze stiegen, obwohl der durchschnittliche Kupon von Versicherungsanleihen trotz der Rally bei 5% stagniert.

Seit Anfang 2024 gab es Neuemissionen in Höhe von fast 12 Milliarden EUR, was im Wesentlichen der Summe aller Emissionen im Jahr 2023 entspricht. Trotz einer erheblichen Spreadverengung lag der Spread bei Emissionen immer noch deutlich über 200 Basispunkten, was die Prämie für die Komplexität von Versicherungen widerspiegelt. Daran konnte auch die Überzeichnung von Neuemissionen durch den Eintritt vieler neuer Marktteilnehmer in diesen normalerweise weniger überfüllten Sektor nichts ändern. Zudem beobachten wir ein proaktiveres Kapitalmanagement von Emittenten im Vergleich zu anderen Sektoren mit mehr Tender-Angeboten (wobei Anleihen von einem Unternehmen zurückgekauft werden) und höheren Aufschlägen bei Tender-Geschäften. Wir behielten unsere auf kürzere Duration ausgerichtete Strategie bei und nahmen nur eine begrenzte „neue Duration“ durch die Beteiligung an Neuemissionen auf. Der NIW des Fonds ist weiter gewachsen und liegt derzeit bei 480 Mio. EUR gegenüber 425 Mio. EUR Ende Juni 2023.

An die Anteilhaber der
JSS Investmentfonds
11-13, Boulevard de la Foire
L-1528 Luxembourg

BERICHT DES RÉVISEUR D'ENTREPRISES AGRÉÉ

Prüfungsurteil

Wir haben den Abschluss von JSS Investmentfonds (die „Gesellschaft“) und aller ihrer Teilfonds geprüft. Er umfasst die Aufstellung des Nettovermögens und die Aufstellung des Wertpapierbestands und sonstigen Nettovermögens zum 30. Juni 2024, die Ertrags- und Aufwandsrechnung, die Entwicklung des Nettovermögens für das zu diesem Zeitpunkt beendete Geschäftsjahr und die Erläuterungen zum Abschluss, darunter eine Zusammenfassung wichtiger Rechnungslegungsgrundsätze.

Nach unserer Auffassung vermittelt der beigefügte Abschluss in Übereinstimmung mit den geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen betreffend die Erstellung und Darstellung von Abschlüssen ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögenslage der Gesellschaft und jedes ihrer Teilfonds zum 30. Juni 2024 sowie der Ergebnisse seiner Transaktionen und der Veränderung seines Nettovermögens für das zu diesem Datum endende Geschäftsjahr.

Grundlage unseres Prüfungsurteils

Wir führten unsere Abschlussprüfung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über den Beruf des Abschlussprüfers („Gesetz vom 23. Juli 2016“) und den in Luxemburg von der „*Commission de Surveillance du Secteur Financier*“ (CSSF) umgesetzten Internationalen Abschlussprüfungsgrundsätzen (ISA) durch. Unsere Verantwortlichkeiten gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den in Luxemburg von der CSSF umgesetzten ISA sind im Abschnitt „*Verantwortlichkeiten des 'Réviseur d'Entreprises Agréé' für die Prüfung des Jahresabschlusses*“ in unserem Bericht näher beschrieben. Wir sind gemäß dem vom internationalen Rat für die Verabschiedung von Standards zur Berufsethik für Wirtschaftsprüfer (International Ethics Standards Board for Accountants, IESBA) herausgegebenen Kodex der ethischen Grundsätze für den Berufsstand (Code of Ethics for Professional Accountants – „IESBA-Code“) einschließlich der internationalen Unabhängigkeitsstandards (International Independence Standards) in der von der CSSF in Luxemburg umgesetzten Form sowie den für unsere Prüfung des Abschlusses relevanten ethischen Anforderungen von der Gesellschaft unabhängig und sind unserer sonstigen ethischen Verantwortung gemäß diesen Anforderungen gerecht geworden. Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

Andere Informationen

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft ist für die anderen Informationen verantwortlich. Die anderen Informationen

umfassen die im Jahresbericht enthaltenen Informationen, jedoch nicht den Abschluss und unseren dazugehörigen Bericht des *Réviseur d'Entreprises Agréé*.

Unser Prüfungsurteil zum Jahresabschluss umfasst nicht die anderen Informationen und wir geben hierzu kein Urteil mit Prüfungssicherheit ab.

Im Zusammenhang mit unserer Prüfung des Jahresabschlusses liegt es in unserer Verantwortlichkeit, die anderen Informationen zu lesen und dabei zu prüfen, ob die anderen Informationen dem Jahresabschluss oder unseren im Rahmen der Prüfung erlangten Erkenntnissen in wesentlicher Hinsicht widersprechen oder ansonsten wesentliche Falschaussagen zu enthalten scheinen. Wenn wir basierend auf der von uns durchgeführten Arbeit zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser anderen Informationen vorliegt, müssen wir über diese Tatsache berichten. Wir haben in dieser Hinsicht nichts zu berichten.

Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats der Gesellschaft bezüglich des Abschlusses

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft ist für die Erstellung und ehrliche Darstellung des Abschlusses gemäß den gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Bestimmungen Luxemburgs für die Erstellung und Darstellung von Abschlüssen und für die entsprechenden internen Kontrollmaßnahmen verantwortlich, die der Verwaltungsrat der Gesellschaft für die Erstellung und Darstellung von Abschlüssen für notwendig erachtet, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind.

Bei der Erstellung des Abschlusses ist der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft verantwortlich für die Beurteilung der Fähigkeit der Gesellschaft zur Fortsetzung des Geschäftsbetriebs. Dabei muss er Angelegenheiten, die sich auf die Fortsetzung des Geschäftsbetriebs und die Verwendung des Grundsatzes der Unternehmensfortführung beziehen, gegebenenfalls offenlegen, es sei denn, der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft hat die Absicht, die Gesellschaft zu liquidieren oder die Geschäftstätigkeit einzustellen, bzw. hat keine realistische Alternative zu diesem Vorgehen.

Verantwortlichkeiten des „Réviseur d'Entreprises Agréé“ für die Prüfung des Jahresabschlusses

Das Ziel unserer Prüfung ist es, eine angemessene Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abschluss insgesamt frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, und einen Bericht des „*Réviseur d'Entreprises Agréé*“ zu erstellen, der unser Prüfungsurteil enthält. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Maß an Sicherheit, jedoch keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den von der CSSF für Luxemburg übernommenen ISA durchgeführte Prüfung alle eventuell bestehenden wesentlichen falschen Darstellungen aufdeckt. Unzutreffende Angaben können auf Betrug oder Irrtum zurückzuführen sein und gelten als wesentlich, wenn davon ausgegangen werden kann, dass sie jeweils einzeln oder in ihrer Gesamtheit die von den Verwendern dieser Jahresabschlüsse getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen beeinflussen können.

Im Rahmen unserer Abschlussprüfung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den von der CSSF für Luxemburg angenommenen internationalen Prüfungsstandards nehmen wir eine fachliche Bewertung vor und wahren dabei ein professionelles Maß an Skepsis. Des Weiteren umfasst unsere Prüfung:

- Wir identifizieren und bewerten das Risiko, dass der Jahresabschluss aufgrund von Irrtum oder Betrug wesentliche unzutreffende Angaben enthält, entwerfen speziell auf diese Risiken zugeschnittene Prüfungsverfahren und wenden diese an und erlangen Prüfungsnachweise, die eine hinreichende und angemessene Grundlage für unser Prüfungsurteil bilden. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen nicht entdeckt werden, ist höher als bei wesentlichen falschen Darstellungen, die aus Irrtümern resultieren, da dolose Handlungen geheime Absprachen, Fälschungen, gezielte Auslassungen, falsche Angaben wesentlicher Umstände oder die Umgehung interner Kontrollen beinhalten können.
- Die Erlangung eines Verständnisses der für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollen, um den Umständen angemessene Prüfungsverfahren zu erarbeiten, jedoch nicht, um eine Meinung über die Wirksamkeit der internen Kontrollen der Gesellschaft abzugeben.
- Die Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsgrundsätze und der vom Verwaltungsrat der Gesellschaft vorgenommenen Schätzungen und der damit in Zusammenhang stehenden Offenlegungen.
- Die Schlussfolgerung, ob der vom Verwaltungsrat der Gesellschaft bei der Erstellung des Abschlusses angewandte Grundsatz der Unternehmensfortführung angemessen ist und ob auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise eine wesentliche Unsicherheit in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen besteht, die die Fähigkeit der Gesellschaft zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit ernsthaft in Zweifel stellen könnten. Sollten wir feststellen, dass erhebliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, in unserem Bericht des „*Réviseur d'Entreprises Agréé*“ auf die betreffenden Angaben des Jahresabschlusses hinzuweisen oder, sofern die Angaben unzureichend sind, unser Prüfungsurteil entsprechend anzupassen. Unsere Schlussfolgerungen basieren auf den bis zum Datum unseres Berichts des „*Réviseur d'Entreprises Agréé*“ erlangten Prüfungsnachweisen. Künftige Ereignisse oder Bedingungen können jedoch dazu führen, dass die Fortführung der Unternehmenstätigkeit der Gesellschaft nicht länger gegeben ist.
- Die Beurteilung der Gesamtdarstellung und Struktur des Abschlusses sowie seines Inhalts einschließlich der Offenlegungen und der Frage, ob die Grundgeschäfte und Ereignisse im Abschluss so dargestellt sind, dass ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild erreicht wird.

Wir kommunizieren mit den für die Überwachung Verantwortlichen, unter anderem in Bezug auf den geplanten Umfang und den Zeitplan für die Abschlussprüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich eventueller bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung entdecken.

Für Deloitte Audit, *Cabinet de révision agréé*

Yann Mérillou, *Réviseur d'entreprises agréé*

Partner

Luxemburg, 23. Oktober 2024

Nettovermögensaufstellung

per 30.06.2024

	Konsolidiert (in EUR)	JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (in USD)	JSS Sustainable Equity -Systematic Emerging Markets (in USD)
AKTIVA			
Wertpapierbestand und Optionskontrakte zum Marktwert	4 728 415 250.92	268 793 175.62	34 428 625.97
Bankguthaben	95 548 749.72	19 093 013.49	598 899.37
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	8 890 276.61	1 113 542.62	-
Forderungen aus Finanzinstrumenten	29 089 988.70	-	-
Ausstehende Zeichnungsbeträge	2 935 482.35	54 237.79	701.20
Forderungen aus Swapzinsen	90 821.75	-	-
Forderungen aus Erträgen von Wertpapieren	26 653 091.95	3 434 778.32	127 115.34
Zinsforderungen aus Bankguthaben	302 136.08	50 502.90	2 808.79
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	464 058.62	9 687.50	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	3 183 364.53	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	183 294.98	-	-
Sonstige Forderungen	312 749.08	-	-
GESAMTAKTIVA	4 896 069 265.29	292 548 938.24	35 158 150.67
PASSIVA			
Banküberziehungen und Verbindlichkeiten	464 058.58	9 687.50	-
Verbindlichkeiten aus Devisengeschäften	746.67	17.20	-
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren	21 143 191.39	14 138 652.88	-
Verbindlichkeiten aus Finanzinstrumenten	28 789 972.34	-	-
Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Aktien	4 889 539.17	369 935.10	2 445.40
Swap-Zinsverbindlichkeiten	305 253.58	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	6 498 546.11	58 200.80	0.93
Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften	110 000.49	-	-
Sonstige Passiva	6 249 963.89	424 117.56	74 364.73
GESAMTPASSIVA	68 451 272.22	15 000 611.04	76 811.06
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	4 827 617 993.07	277 548 327.20	35 081 339.61

Nettovermögensaufstellung (Fortsetzung)

per 30.06.2024

	JSS Sustainable Equity - Global Dividend (in USD)	JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) (in EUR)	JSS Twelve Sustainable Insurance Bond (in EUR)
AKTIVA			
Wertpapierbestand und Optionskontrakte zum Marktwert	335 903 890.13	60 524 994.85	458 374 371.39
Bankguthaben	3 858 871.28	1 238 283.11	8 564 801.63
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	-	-	-
Forderungen aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zeichnungsbeträge	321 767.98	-	126 690.80
Forderungen aus Swapzinsen	-	-	-
Forderungen aus Erträgen von Wertpapieren	179 377.83	285 598.90	9 020 539.81
Zinsforderungen aus Bankguthaben	20 589.60	2 579.98	19 528.68
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	15 606.83	-	2 573 997.37
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	-	-	-
Sonstige Forderungen	77 762.97	3 415.16	-
GESAMTAKTIVA	340 377 866.62	62 054 872.00	478 679 929.68
PASSIVA			
Banküberziehungen und Verbindlichkeiten	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Devisengeschäften	-	-	-
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Aktien	58 938.00	8 029.68	-
Swap-Zinsverbindlichkeiten	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	-	1 748.63	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften	-	-	-
Sonstige Passiva	318 897.71	109 683.64	487 846.60
GESAMTPASSIVA	377 835.71	119 461.95	487 846.60
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	340 000 030.91	61 935 410.05	478 192 083.08

Nettovermögensaufstellung (Fortsetzung)

per 30.06.2024

	JSS Sustainable Equity - Global Thematic (in EUR)	JSS Sustainable Bond - Global Short-term (in USD)	JSS Sustainable Bond CHF (in CHF)
AKTIVA			
Wertpapierbestand und Optionskontrakte zum Marktwert	866 272 918.55	206 877 903.11	18 902 989.43
Bankguthaben	7 283 804.28	4 537 724.92	840 751.16
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	2 544 738.00	-	-
Forderungen aus Finanzinstrumenten	29 089 988.70*	-	-
Ausstehende Zeichnungsbeträge	48 712.17	-	687.00
Forderungen aus Swapzinsen	-	-	-
Forderungen aus Erträgen von Wertpapieren	539 267.80	2 627 757.72	101 793.09
Zinsforderungen aus Bankguthaben	21 032.00	18 706.77	312.17
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	-	4 296.85	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	-	89 872.44	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	-	-	-
Sonstige Forderungen	17 302.52	-	-
GESAMTAKTIVA	905 817 764.02	214 156 261.81	19 846 532.85
PASSIVA			
Banküberziehungen und Verbindlichkeiten	-	4 296.85	-
Verbindlichkeiten aus Devisengeschäften	-	-	-
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren	-	2 285 564.13	100 000.00
Verbindlichkeiten aus Finanzinstrumenten	28 789 972.34	-	-
Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Aktien	157 526.60	-	-
Swap-Zinsverbindlichkeiten	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	4 013 077.51	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften	-	-	-
Sonstige Passiva	1 380 901.80	226 239.23	32 021.62
GESAMTPASSIVA	34 341 478.25	2 516 100.21	132 021.62
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	871 476 285.77	211 640 161.60	19 714 511.23

* Siehe Erläuterung 9.

Nettovermögensaufstellung (Fortsetzung)

per 30.06.2024

	JSS Sustainable Bond - Euro Broad (in EUR)	JSS Sustainable Bond - EUR Corporates (in EUR)	JSS Sustainable Equity - Europe (in EUR)
AKTIVA			
Wertpapierbestand und Optionskontrakte zum Marktwert	205 909 556.14	98 734 155.20	44 923 112.10
Bankguthaben	3 128 207.99	8 263 046.51	356 637.09
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	3 579 073.17	-	384 494.16
Forderungen aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zeichnungsbeträge	32 771.64	22 947.54	838.31
Forderungen aus Swapzinsen	90 821.75	-	-
Forderungen aus Erträgen von Wertpapieren	1 731 070.39	1 204 324.40	21 710.69
Zinsforderungen aus Bankguthaben	3 478.42	10 882.20	754.97
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	6 465.86	21 304.32	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	222 631.16	120 941.00	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	7 976.30	-	-
Sonstige Forderungen	-	-	36 864.55
GESAMTAKTIVA	214 712 052.82	108 377 601.17	45 724 411.87
PASSIVA			
Banküberziehungen und Verbindlichkeiten	6 465.69	21 304.32	-
Verbindlichkeiten aus Devisengeschäften	-	0.81	-
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren	1 683 425.00	-	-
Verbindlichkeiten aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Aktien	636 092.12	594 790.71	146 948.70
Swap-Zinsverbindlichkeiten	80 029.97	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften	-	-	-
Sonstige Passiva	141 722.50	83 986.84	71 313.44
GESAMTPASSIVA	2 547 735.28	700 082.68	218 262.14
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	212 164 317.54	107 677 518.49	45 506 149.73

Nettovermögensaufstellung (Fortsetzung)

per 30.06.2024

	JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 (in EUR)	JSS Sustainable Equity - Real Estate Global (in EUR)	JSS Sustainable Equity - USA (in USD)
AKTIVA			
Wertpapierbestand und Optionskontrakte zum Marktwert	101 178 891.07	27 678 785.33	299 037 022.67
Bankguthaben	1 254 920.41	344 495.22	5 057 052.51
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	-	54 774.85	-
Forderungen aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zeichnungsbeträge	51 690.78	2 544.13	22 496.10
Forderungen aus Swapzinsen	-	-	-
Forderungen aus Erträgen von Wertpapieren	73 046.12	84 805.04	194 868.47
Zinsforderungen aus Bankguthaben	3 902.25	751.82	26 053.77
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	-	17.04	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	-	-	-
Sonstige Forderungen	12 375.06	2 437.67	-
GESAMTAKTIVA	102 574 825.69	28 168 611.10	304 337 493.52
PASSIVA			
Banküberziehungen und Verbindlichkeiten	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Devisengeschäften	-	209.13	-
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Aktien	1 028.28	96.79	269 707.94
Swap-Zinsverbindlichkeiten	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	-	-	82 630.21
Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften	-	-	-
Sonstige Passiva	132 654.92	59 584.91	250 693.22
GESAMTPASSIVA	133 683.20	59 890.83	603 031.37
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	102 441 142.49	28 108 720.27	303 734 462.15

Nettovermögensaufstellung (Fortsetzung)

per 30.06.2024

	JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (in EUR)	JSS Sustainable Equity - Green Planet (in EUR)	JSS Bond - USD High Yield (in USD)
AKTIVA			
Wertpapierbestand und Optionskontrakte zum Marktwert	312 228 042.63	392 795 071.55	160 188 857.27
Bankguthaben	4 340 773.09	6 344 495.17	5 369 015.24
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	-	-	-
Forderungen aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zeichnungsbeträge	6 115.37	67 801.64	-
Forderungen aus Swapzinsen	-	-	-
Forderungen aus Erträgen von Wertpapieren	1 469 112.12	540 371.61	2 673 108.46
Zinsforderungen aus Bankguthaben	19 184.92	19 187.17	18 539.92
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	-	167 360.17	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	-	-	-
Sonstige Forderungen	84 268.85	35 588.87	-
GESAMTAKTIVA	318 147 496.98	399 969 876.18	168 249 520.89
PASSIVA			
Banküberziehungen und Verbindlichkeiten	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Devisengeschäften	14.87	251.53	-
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren	-	-	482 359.38
Verbindlichkeiten aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Aktien	52 171.19	1 380 643.39	-
Swap-Zinsverbindlichkeiten	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	814 589.20	-	116 841.86
Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften	-	-	-
Sonstige Passiva	495 218.68	583 961.21	314 356.49
GESAMTPASSIVA	1 361 993.94	1 964 856.13	913 557.73
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	316 785 503.04	398 005 020.05	167 335 963.16

Nettovermögensaufstellung (Fortsetzung)

per 30.06.2024

	JSS Sustainable Bond - Total Return Global (in USD)	JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer (in USD)	JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors (in USD)
AKTIVA			
Wertpapierbestand und Optionskontrakte zum Marktwert	290 657 211.27	53 747 722.15	405 843 287.91
Bankguthaben	3 985 453.49	3 126 674.52	5 383 542.68
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	-	940 725.36	-
Forderungen aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zeichnungsbeträge	6 711.84	4 303.20	2 336 285.60
Forderungen aus Swapzinsen	-	-	-
Forderungen aus Erträgen von Wertpapieren	2 360 036.33	2 669.94	-
Zinsforderungen aus Bankguthaben	17 001.17	8 115.88	22 494.29
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	453 607.79	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	187 897.80	-	-
Sonstige Forderungen	-	-	51 379.05
GESAMTAKTIVA	297 667 919.69	57 830 211.05	413 636 989.53
PASSIVA			
Banküberziehungen und Verbindlichkeiten	453 607.92	-	-
Verbindlichkeiten aus Devisengeschäften	-	272.53	-
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren	-	1 649 298.94	1 881 158.85
Verbindlichkeiten aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Aktien	829 619.11	218 124.09	35 485.66
Swap-Zinsverbindlichkeiten	241 383.41	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	1 396 683.77	-	126 194.46
Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften	117 893.02	-	-
Sonstige Passiva	270 935.00	64 373.19	510 002.79
GESAMTPASSIVA	3 310 122.23	1 932 068.75	2 552 841.76
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	294 357 797.46	55 898 142.30	411 084 147.77

Nettovermögensaufstellung (Fortsetzung)

per 30.06.2024

	JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency (in USD)	JSS Equity - All China (in USD)	JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus* (in CHF)
AKTIVA			
Wertpapierbestand und Optionskontrakte zum Marktwert	11 487 773.66	206 370 129.83	18 321 595.00
Bankguthaben	1 195 028.78	3 815 945.66	1 238 039.15
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	-	439 904.79	-
Forderungen aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zeichnungsbeträge	-	12 539.26	310.26
Forderungen aus Swapzinsen	-	-	-
Forderungen aus Erträgen von Wertpapieren	203 901.67	604 624.23	-
Zinsforderungen aus Bankguthaben	3 513.34	23 624.64	2 665.66
Nicht realisierter Nettogewinn aus Terminkontrakten	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Devisentermingeschäften	-	-	-
Nicht realisierter Nettogewinn aus Swapgeschäften	-	-	-
Sonstige Forderungen	-	-	-
GESAMTAKTIVA	12 890 217.45	211 266 768.41	19 562 610.07
PASSIVA			
Banküberziehungen und Verbindlichkeiten	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Devisengeschäften	-	-	-
Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren	-	307 686.28	-
Verbindlichkeiten aus Finanzinstrumenten	-	-	-
Ausstehende Zahlungen aus dem Rückkauf von Aktien	-	265 157.60	-
Swap-Zinsverbindlichkeiten	-	-	-
Nicht realisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	4 265.16	531.11	3 183.38
Nicht realisierter Nettoverlust aus Swapgeschäften	-	-	-
Sonstige Passiva	33 218.83	349 822.31	21 907.86
GESAMTPASSIVA	37 483.99	923 197.30	25 091.24
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	12 852 733.46	210 343 571.11	19 537 518.83

* Siehe Erläuterung 17

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens

Für das Geschäftsjahr vom 01.07.2023 bis zum 30.06.2024

	Konsolidiert (in EUR)	JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (in USD)	JSS Sustainable Equity -Systematic Emerging Markets (in USD)
NETTOVERMÖGEN zu Beginn des Geschäftsjahres	4 786 959 018.32	387 029 426.36	40 540 256.47
ERTRÄGE			
Nettodividendenerträge	38 604 579.44	-	746 773.36
Zinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen	80 108 482.52	16 306 065.28	-
Zinsen auf Bankguthaben	4 287 751.27	514 442.19	36 769.16
Zinserträge aus Swaps	490 265.23	-	-
Sonstige Erträge	566 292.09	22 512.93	4 965.30
Gesamterträge	124 057 370.55	16 843 020.40	788 507.82
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgesellschaftsgebühr	49 141 171.09	2 599 972.14	449 612.57
Verwahrstellengebühr	618 661.16	51 223.26	21 586.00
Transaktionskosten	685 115.05	15 808.58	10 551.24
Zentralverwaltungsaufwand	8 074 781.92	742 241.40	86 324.27
Prüfungskosten	161 492.00	10 502.48	5 190.92
Kapitalsteuern	1 881 527.00	114 705.15	13 490.69
Zinsaufwendungen aus Swaps	534 598.49	-	-
Sonstige Aufwendungen*	3 857 395.96	290 541.84	34 211.66
Gesamtaufwendungen	64 954 742.67	3 824 994.85	620 967.35
SUMME DER NETTOERTRÄGE/NETTOVERLUSTE	59 102 627.88	13 018 025.55	167 540.47
Nettorealisierte Werterhöhungen/Wertverminderungen			
- aus Wertpapieren	-126 523 502.72	-11 854 858.45	-8 959 844.80
- aus Optionen/Warrants	-3 338 492.35	-	-
- aus Swapgeschäften	388 099.69	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-185 311.77	278 546.40	-
- aus Devisenterminkontrakten	-17 082 333.30	-2 094 644.51	6 751.20
- aus Devisen	79 518.48	-438 364.97	-34 902.13
REALISIERTES ERGEBNIS	-87 559 394.09	-1 091 295.98	-8 820 455.26
Nettoveränderung der nicht realisierten Zuschreibung/Abschreibung			
- aus Wertpapieren	523 658 007.20	17 849 340.40	8 776 107.05
- aus Optionen/Warrants	522 271.26	-	-
- aus Swapgeschäften	-334 737.29	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	863 044.66	-23 906.25	-
- aus Devisenterminkontrakten	-9 228 854.30	-914 988.31	-0.94
ERGEBNIS	427 920 337.44	15 819 149.86	-44 349.15
Ausschüttungen	-30 991 866.53	-2 612 553.53	-
Nettomittelzuflüsse/-abflüsse aus Zeichnungen und Rücknahmen	-400 636 229.92	-122 687 695.49	-5 414 567.71
SUMME DER VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS	-3 707 759.01	-109 481 099.16	-5 458 916.86
Bewertungsdifferenz	44 366 733.76	-	-
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	4 827 617 993.07	277 548 327.20	35 081 339.61

* Die sonstigen Aufwendungen enthalten unter anderem Druck- und Veröffentlichungsgebühren.

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr vom 01.07.2023 bis zum 30.06.2024

	JSS Sustainable Equity - Global Dividend (in USD)	JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF)** (in CHF)	JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) (in EUR)
NETTOVERMÖGEN zu Beginn des Geschäftsjahres	339 003 245.65	118 839 993.22	47 399 259.68
ERTRÄGE			
Nettodividendenerträge	8 761 950.29	235 391.06	478 913.41
Zinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen	-	488 184.62	672 883.49
Zinsen auf Bankguthaben	187 784.97	13 560.78	22 786.95
Zinserträge aus Swaps	-	-	-
Sonstige Erträge	-	1 237.70	402.53
Gesamterträge	8 949 735.26	738 374.16	1 174 986.38
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgesellschaftsgebühr	2 571 714.12	523 138.78	789 597.14
Verwahrstellengebühr	32 248.03	6 775.09	7 377.19
Transaktionskosten	25 602.39	1 867.61	5 914.86
Zentralverwaltungsaufwand	463 005.68	70 489.69	136 458.32
Prüfungskosten	6 311.96	2 870.47	3 441.79
Kapitalsteuern	142 659.73	16 586.21	27 662.07
Zinsaufwendungen aus Swaps	-	-	-
Sonstige Aufwendungen*	343 304.75	10 564.46	31 589.33
Gesamtaufwendungen	3 584 846.66	632 292.31	1 002 040.70
SUMME DER NETTOERTRÄGE/NETTOVERLUSTE	5 364 888.60	106 081.85	172 945.68
Nettorealisierte Werterhöhungen/Wertverminderungen			
- aus Wertpapieren	12 044 883.58	-15 832 555.60	-505 295.41
- aus Optionen/Warrants	1 178 401.32	-154 178.62	-215 037.45
- aus Swapgeschäften	-	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-	-	-
- aus Devisenterminkontrakten	11 968.35	1 445 469.14	-332 905.60
- aus Devisen	-120 443.82	-165 170.38	-15 541.91
REALISIERTES ERGEBNIS	18 479 698.03	-14 600 353.61	-895 834.69
Nettoveränderung der nicht realisierten Zuschreibung/Abschreibung			
- aus Wertpapieren	10 498 542.16	9 332 051.08	7 826 440.34
- aus Optionen/Warrants	-	59 126.46	12 076.30
- aus Swapgeschäften	-	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-	-	-
- aus Devisenterminkontrakten	-8 047.17	-330 854.92	-63 531.49
ERGEBNIS	28 970 193.02	-5 540 030.99	6 879 150.46
Ausschüttungen	-1 839 418.86	-14 760 886.56	-
Nettomittelzuflüsse/-abflüsse aus Zeichnungen und Rücknahmen	-26 133 988.90	-98 539 075.67	7 656 999.91
SUMME DER VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS	996 785.26	-118 839 993.22	14 536 150.37
Bewertungsdifferenz	-	-	-
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	340 000 030.91	-	61 935 410.05

* Die sonstigen Aufwendungen enthalten unter anderem Druck- und Veröffentlichungsgebühren.

** Siehe Erläuterung 17

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr vom 01.07.2023 bis zum 30.06.2024

	JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR)** (in EUR)	JSS Twelve Sustainable Insurance Bond (in EUR)	JSS Sustainable Equity - Global Thematic (in EUR)
NETTOVERMÖGEN zu Beginn des Geschäftsjahres	19 951 497.41	425 152 140.94	981 578 470.46
ERTRÄGE			
Nettodividendenerträge	64 506.65	-	11 407 989.10
Zinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen	35 830.99	21 882 759.32	-
Zinsen auf Bankguthaben	4 835.97	394 742.48	704 291.45
Zinserträge aus Swaps	-	-	-
Sonstige Erträge	36.15	501.08	474 608.09
Gesamterträge	105 209.76	22 278 002.88	12 586 888.64
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgesellschaftsgebühr	96 630.51	2 387 447.19	13 097 169.00
Verwahrstellengebühr	2 378.25	48 556.58	85 660.09
Transaktionskosten	2 097.78	1 234.80	1 432.25
Zentralverwaltungsaufwand	14 094.71	318 509.76	1 884 757.74
Prüfungskosten	1 750.49	10 220.26	13 328.58
Kapitalsteuern	3 023.48	76 333.88	360 981.61
Zinsaufwendungen aus Swaps	-	-	-
Sonstige Aufwendungen*	2 605.35	504 905.52	425 695.49
Gesamtaufwendungen	122 580.57	3 347 207.99	15 869 024.76
SUMME DER NETTOERTRÄGE/NETTOVERLUSTE	-17 370.81	18 930 794.89	-3 282 136.12
Nettorealisierte Werterhöhungen/Wertvermindierungen			
- aus Wertpapieren	1 283 843.61	-12 147 098.89	-64 475 554.66
- aus Optionen/Warrants	-15 264.39	-	-
- aus Swapgeschäften	-	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-	-	-
- aus Devisenterminkontrakten	-152 683.24	-10 339 373.22	88 029.03
- aus Devisen	2 184.21	1 281 759.96	51 425.28
REALISIERTES ERGEBNIS	1 100 709.38	-2 273 917.26	-67 618 236.47
Nettoveränderung der nicht realisierten Zuschreibung/Abschreibung			
- aus Wertpapieren	-2 148 233.66	41 364 336.12	180 664 727.85
- aus Optionen/Warrants	5 609.08	-	-
- aus Swapgeschäften	-	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-	-	-
- aus Devisenterminkontrakten	-44 449.67	4 770 756.57	-6 521 156.77
ERGEBNIS	-1 086 364.87	43 861 175.43	106 525 334.61
Ausschüttungen	-	-1 104 828.49	-
Nettomittelzuflüsse/-abflüsse aus Zeichnungen und Rücknahmen	-18 865 132.54	10 283 595.20	-216 627 519.30
SUMME DER VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS	-19 951 497.41	53 039 942.14	-110 102 184.69
Bewertungsdifferenz	-	-	-
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	-	478 192 083.08	871 476 285.77

* Die sonstigen Aufwendungen enthalten unter anderem Druck- und Veröffentlichungsgebühren.

** Siehe Erläuterung 17

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr vom 01.07.2023 bis zum 30.06.2024

	JSS Sustainable Bond - Global Short-term (in USD)	JSS Sustainable Bond CHF (in CHF)	JSS Sustainable Bond - Euro Broad (in EUR)
NETTOVERMÖGEN zu Beginn des Geschäftsjahres	261 194 360.18	20 717 397.37	118 083 230.03
ERTRÄGE			
Nettodividendenerträge	-	-	-
Zinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen	11 015 921.66	244 362.53	3 414 886.31
Zinsen auf Bankguthaben	194 979.59	5 276.79	205 723.48
Zinserträge aus Swaps	-	-	314 921.76
Sonstige Erträge	235.24	-	-
Gesamterträge	11 211 136.49	249 639.32	3 935 531.55
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgesellschaftsgebühr	1 757 917.11	109 206.76	851 179.85
Verwahrstellengebühr	31 739.93	5 047.79	30 594.90
Transaktionskosten	3 279.62	600.38	40 154.04
Zentralverwaltungsaufwand	286 780.78	49 760.51	83 180.17
Prüfungskosten	11 896.45	4 029.37	5 668.14
Kapitalsteuern	114 351.38	8 100.38	73 787.78
Zinsaufwendungen aus Swaps	-	-	280 854.13
Sonstige Aufwendungen*	301 177.03	11 329.89	358 897.28
Gesamtaufwendungen	2 507 142.30	188 075.08	1 724 316.29
SUMME DER NETTOERTRÄGE/NETTOVERLUSTE	8 703 994.19	61 564.24	2 211 215.26
Nettorealisierte Werterhöhungen/Wertverminderungen			
- aus Wertpapieren	-602 870.88	-653 772.78	-2 177 500.59
- aus Optionen/Warrants	-	-	-339 200.00
- aus Swapgeschäften	-	-	242 438.13
- aus Terminkontrakten und CFD	70 117.07	-	103 914.35
- aus Devisenterminkontrakten	-365 494.86	-3.97	-549 478.89
- aus Devisen	-330 122.14	919.52	-185.09
REALISIERTES ERGEBNIS	7 475 623.38	-591 292.99	-508 796.83
Nettoveränderung der nicht realisierten Zuschreibung/Abschreibung			
- aus Wertpapieren	5 035 725.46	1 392 314.64	5 902 111.61
- aus Optionen/Warrants	-	-	-
- aus Swapgeschäften	-	-	-23 411.85
- aus Terminkontrakten und CFD	4 296.85	-	14 484.57
- aus Devisenterminkontrakten	-438 541.44	-	293 741.36
ERGEBNIS	12 077 104.25	801 021.65	5 678 128.86
Ausschüttungen	-4 884 853.62	-	-
Nettomittelzuflüsse/-abflüsse aus Zeichnungen und Rücknahmen	-56 746 449.21	-1 803 907.79	88 402 958.65
SUMME DER VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS	-49 554 198.58	-1 002 886.14	94 081 087.51
Bewertungsdifferenz	-	-	-
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	211 640 161.60	19 714 511.23	212 164 317.54

* Die sonstigen Aufwendungen enthalten unter anderem Druck- und Veröffentlichungsgebühren.

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr vom 01.07.2023 bis zum 30.06.2024

	JSS Sustainable Bond - EUR Corporates (in EUR)	JSS Sustainable Equity - Europe (in EUR)	JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 (in EUR)
NETTOVERMÖGEN zu Beginn des Geschäftsjahres	86 962 536.60	37 725 133.92	87 946 471.48
ERTRÄGE			
Nettodividendenerträge	-	1 036 670.98	983 782.47
Zinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen	2 850 247.05	-	-
Zinsen auf Bankguthaben	103 454.50	10 248.05	23 847.48
Zinserträge aus Swaps	-	-	-
Sonstige Erträge	22.02	0.62	1 517.21
Gesamterträge	2 953 723.57	1 046 919.65	1 009 147.16
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgesellschaftsgebühr	463 308.68	489 001.86	1 171 934.88
Verwahrstellengebühr	16 928.75	7 918.40	10 889.18
Transaktionskosten	5 843.28	1 543.55	5 843.45
Zentralverwaltungsaufwand	216 722.04	94 028.24	199 158.32
Prüfungskosten	5 667.35	4 361.33	5 180.41
Kapitalsteuern	47 352.11	20 587.16	41 193.14
Zinsaufwendungen aus Swaps	-	-	-
Sonstige Aufwendungen*	39 903.20	19 375.37	42 657.94
Gesamtaufwendungen	795 725.41	636 815.91	1 476 857.32
SUMME DER NETTOERTRÄGE/NETTOVERLUSTE	2 157 998.16	410 103.74	-467 710.16
Nettorealisierte Werterhöhungen/Wertverminderungen			
- aus Wertpapieren	-1 780 568.88	1 751 387.13	2 460 885.89
- aus Optionen/Warrants	-43 240.00	-	-
- aus Swapgeschäften	-	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-120 288.44	-	-
- aus Devisenterminkontrakten	-315 778.60	291.72	-833.08
- aus Devisen	-2 556.85	-14 573.07	-2 629.08
REALISIERTES ERGEBNIS	-104 434.61	2 147 209.52	1 989 713.57
Nettoveränderung der nicht realisierten Zuschreibung/Abschreibung			
- aus Wertpapieren	5 748 051.56	1 485 635.69	13 628 026.03
- aus Optionen/Warrants	-	-	-
- aus Swapgeschäften	-	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	22 948.41	-	-
- aus Devisenterminkontrakten	181 639.73	-	-
ERGEBNIS	5 848 205.09	3 632 845.21	15 617 739.60
Ausschüttungen	-588 335.06	-	-
Nettomittelzuflüsse/-abflüsse aus Zeichnungen und Rücknahmen	15 455 111.86	4 148 170.60	-1 123 068.59
SUMME DER VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS	20 714 981.89	7 781 015.81	14 494 671.01
Bewertungsdifferenz	-	-	-
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	107 677 518.49	45 506 149.73	102 441 142.49

* Die sonstigen Aufwendungen enthalten unter anderem Druck- und Veröffentlichungsgebühren.

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr vom 01.07.2023 bis zum 30.06.2024

	JSS Sustainable Equity - Real Estate Global (in EUR)	JSS Sustainable Equity - USA (in USD)	JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (in EUR)
NETTOVERMÖGEN zu Beginn des Geschäftsjahres	30 326 940.40	181 027 396.73	196 614 944.70
ERTRÄGE			
Nettodividendenerträge	966 780.93	1 662 233.78	2 521 828.19
Zinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen	-	-	3 984 293.54
Zinsen auf Bankguthaben	28 149.08	114 060.16	185 280.08
Zinserträge aus Swaps	-	-	-
Sonstige Erträge	3.77	2 666.90	5 146.90
Gesamterträge	994 933.78	1 778 960.84	6 696 548.71
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgesellschaftsgebühr	360 835.17	1 610 476.46	3 821 415.70
Verwahrstellengebühr	4 815.71	14 243.31	49 931.53
Transaktionskosten	1 840.48	2 799.24	31 439.63
Zentralverwaltungsaufwand	75 222.17	458 744.79	57 068.32
Prüfungskosten	4 270.88	6 063.04	6 155.42
Kapitalsteuern	9 888.35	93 658.62	129 000.68
Zinsaufwendungen aus Swaps	-	-	-
Sonstige Aufwendungen*	13 378.92	102 967.77	629 243.03
Gesamtaufwendungen	470 251.68	2 288 953.23	4 724 254.31
SUMME DER NETTOERTRÄGE/NETTOVERLUSTE	524 682.10	-509 992.39	1 972 294.40
Nettorealisierte Werterhöhungen/Wertverminderungen			
- aus Wertpapieren	-641 215.30	5 390 714.46	15 643 319.75
- aus Optionen/Warrants	-	-	-3 867 714.36
- aus Swapgeschäften	-	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-	-	79 890.48
- aus Devisenterminkontrakten	-2 688.65	-32 724.26	-2 492 863.09
- aus Devisen	-11 510.09	-4 343.10	-211 619.08
REALISIERTES ERGEBNIS	-130 731.94	4 843 654.71	11 123 308.10
Nettoveränderung der nicht realisierten Zuschreibung/Abschreibung			
- aus Wertpapieren	3 044 629.84	44 748 367.26	13 035 464.55
- aus Optionen/Warrants	-	-	443 192.47
- aus Swapgeschäften	-	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-	-	-
- aus Devisenterminkontrakten	2.48	-82 630.21	-993 775.51
ERGEBNIS	2 913 900.38	49 509 391.76	23 608 189.61
Ausschüttungen	-14 832.68	-	-884 614.23
Nettomittelzuflüsse/-abflüsse aus Zeichnungen und Rücknahmen	-5 117 287.83	73 197 673.66	97 446 982.96
SUMME DER VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS	-2 218 220.13	122 707 065.42	120 170 558.34
Bewertungsdifferenz	-	-	-
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	28 108 720.27	303 734 462.15	316 785 503.04

* Die sonstigen Aufwendungen enthalten unter anderem Druck- und Veröffentlichungsgebühren.

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr vom 01.07.2023 bis zum 30.06.2024

	JSS Sustainable Equity - Green Planet (in EUR)	JSS Bond - USD High Yield (in USD)	JSS Sustainable Bond - Total Return Global (in USD)
NETTOVERMÖGEN zu Beginn des Geschäftsjahres	356 485 094.29	187 466 007.32	430 886 055.43
ERTRÄGE			
Nettodividendenerträge	4 302 351.19	77 434.03	-
Zinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen	-	10 476 931.63	10 741 856.95
Zinsen auf Bankguthaben	311 832.25	209 063.63	336 191.75
Zinserträge aus Swaps	-	-	187 924.36
Sonstige Erträge	2 879.97	52 098.93	-
Gesamterträge	4 617 063.41	10 815 528.22	11 265 973.06
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgesellschaftsgebühr	5 053 172.60	2 336 580.08	2 136 838.71
Verwahrstellengebühr	29 475.51	8 079.53	53 810.76
Transaktionskosten	4 113.00	5 592.15	51 385.44
Zentralverwaltungsaufwand	743 098.94	361 981.32	780 008.87
Prüfungskosten	10 384.44	9 562.60	12 120.68
Kapitalsteuern	161 751.55	83 483.39	140 319.72
Zinsaufwendungen aus Swaps	-	-	271 950.52
Sonstige Aufwendungen*	157 751.89	146 455.38	137 961.10
Gesamtaufwendungen	6 159 747.93	2 951 734.45	3 584 395.80
SUMME DER NETTOERTRÄGE/NETTOVERLUSTE	-1 542 684.52	7 863 793.77	7 681 577.26
Nettorealisierte Werterhöhungen/Wertvermindierungen			
- aus Wertpapieren	-8 943 979.59	-6 192 418.29	-24 981 545.30
- aus Optionen/Warrants	-	-	217 074.83
- aus Swapgeschäften	-	-	156 112.78
- aus Terminkontrakten und CFD	-	-	-593 899.74
- aus Devisenterminkontrakten	-416 467.79	-506 197.26	-1 391 574.44
- aus Devisen	-120 549.10	-5 309.72	837 790.65
REALISIERTES ERGEBNIS	-11 023 681.00	1 159 868.50	-18 074 463.96
Nettoveränderung der nicht realisierten Zuschreibung/Abschreibung			
- aus Wertpapieren	43 806 332.90	12 610 998.02	26 494 635.87
- aus Optionen/Warrants	-	-	-
- aus Swapgeschäften	-	-	-333 663.04
- aus Terminkontrakten und CFD	-	-	896 489.97
- aus Devisenterminkontrakten	175 470.80	-1 464.42	-5 419 394.15
ERGEBNIS	32 958 122.70	13 769 402.10	3 563 604.69
Ausschüttungen	-	-1 892 667.56	-2 281 414.60
Nettomittelzuflüsse/-abflüsse aus Zeichnungen und Rücknahmen	8 561 803.06	-32 006 778.70	-137 810 448.06
SUMME DER VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS	41 519 925.76	-20 130 044.16	-136 528 257.97
Bewertungsdifferenz	-	-	-
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	398 005 020.05	167 335 963.16	294 357 797.46

* Die sonstigen Aufwendungen enthalten unter anderem Druck- und Veröffentlichungsgebühren.

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr vom 01.07.2023 bis zum 30.06.2024

	JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer (in USD)	JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors (in USD)	JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency (in USD)
NETTOVERMÖGEN zu Beginn des Geschäftsjahres	53 822 658.01	256 202 566.94	29 384 938.73
ERTRÄGE			
Nettodividendenerträge	460 062.49	1 317 298.46	-
Zinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen	-	-	1 303 046.30
Zinsen auf Bankguthaben	108 609.14	327 690.34	77 483.90
Zinserträge aus Swaps	-	-	-
Sonstige Erträge	-	3 128.61	12.27
Gesamterträge	568 671.63	1 648 117.41	1 380 542.47
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgesellschaftsgebühr	460 067.09	3 614 663.62	220 546.49
Verwahrstellengebühr	19 388.81	29 038.58	13 767.11
Transaktionskosten	121 681.35	348 717.26	16 660.37
Zentralverwaltungsaufwand	133 050.21	599 644.87	29 048.40
Prüfungskosten	4 351.85	9 153.07	5 389.41
Kapitalsteuern	27 735.98	131 582.09	8 692.86
Zinsaufwendungen aus Swaps	-	-	-
Sonstige Aufwendungen*	51 964.38	129 133.99	61 376.89
Gesamtaufwendungen	818 239.67	4 861 933.48	355 481.53
SUMME DER NETTOERTRÄGE/NETTOVERLUSTE	-249 568.04	-3 213 816.07	1 025 060.94
Nettorealisierte Werterhöhungen/Wertverminderungen			
- aus Wertpapieren	3 212 723.07	33 021 540.33	-4 891 688.40
- aus Optionen/Warrants	-	-	-
- aus Swapgeschäften	-	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-	-	-21 445.32
- aus Devisenterminkontrakten	-430.22	19 766.30	-28 989.44
- aus Devisen	-58 913.43	-154 368.19	-70 584.63
REALISIERTES ERGEBNIS	2 903 811.38	29 673 122.37	-3 987 646.85
Nettoveränderung der nicht realisierten Zuschreibung/Abschreibung			
- aus Wertpapieren	5 414 306.82	58 103 567.80	1 963 610.89
- aus Optionen/Warrants	-	-	-
- aus Swapgeschäften	-	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-	-	7 968.75
- aus Devisenterminkontrakten	-	-178 346.80	-116 147.99
ERGEBNIS	8 318 118.20	87 598 343.37	-2 132 215.20
Ausschüttungen	-	-	-499 464.74
Nettomittelzuflüsse/-abflüsse aus Zeichnungen und Rücknahmen	-6 242 633.91	67 283 237.46	-15 960 746.79
SUMME DER VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS	2 075 484.29	154 881 580.83	-18 592 426.73
Bewertungsdifferenz	-	-	2 060 221.46**
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	55 898 142.30	411 084 147.77	12 852 733.46

* Die sonstigen Aufwendungen enthalten unter anderem Druck- und Veröffentlichungsgebühren.

** Siehe Erläuterung 17

Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr vom 01.07.2023 bis zum 30.06.2024

	JSS Equity - All China (in USD)	JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus (in CHF)
NETTOVERMÖGEN zu Beginn des Geschäftsjahres	294 470 045.34	-
ERTRÄGE		
Nettodividendenerträge	4 543 523.51	196 724.88
Zinserträge aus Anleihen und anderen Schuldverschreibungen	-	-
Zinsen auf Bankguthaben	311 774.92	15 489.77
Zinserträge aus Swaps	-	-
Sonstige Erträge	0.42	-
Gesamterträge	4 855 298.85	212 214.65
AUFWENDUNGEN		
Verwaltungsgesellschaftsgebühr	3 496 184.65	68 605.97
Verwahrstellengebühr	57 456.57	1 485.28
Transaktionskosten	20 711.26	-
Zentralverwaltungsaufwand	479 900.67	2 739.08
Prüfungskosten	6 175.56	2 875.72
Kapitalsteuern	94 116.21	3 973.71
Zinsaufwendungen aus Swaps	-	-
Sonstige Aufwendungen*	88 721.32	32 586.85
Gesamtaufwendungen	4 243 266.24	112 266.61
SUMME DER NETTOERTRÄGE/NETTOVERLUSTE	612 032.61	99 948.04
Nettorealisierte Werterhöhungen/Wertverminderungen		
- aus Wertpapieren	-38 919 799.59	-938.57
- aus Optionen/Warrants	-	-
- aus Swapgeschäften	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-	-
- aus Devisenterminkontrakten	-29 581.71	45 622.91
- aus Devisen	-394 844.20	15 817.09
REALISIERTES ERGEBNIS	-38 732 192.89	160 449.47
Nettoveränderung der nicht realisierten Zuschreibung/Abschreibung		
- aus Wertpapieren	20 898 882.23	-9 714.76
- aus Optionen/Warrants	-	-
- aus Swapgeschäften	-	-
- aus Terminkontrakten und CFD	-	-
- aus Devisenterminkontrakten	-485.47	-3 183.38
ERGEBNIS	-17 833 796.13	147 551.33
Ausschüttungen	-	-
Nettomittelzuflüsse/-abflüsse aus Zeichnungen und Rücknahmen	-66 292 678.10	19 389 967.50
SUMME DER VERÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS	-84 126 474.23	19 537 518.83
Bewertungsdifferenz	-	-
NETTOVERMÖGEN am Ende des Geschäftsjahres	210 343 571.11	19 537 518.83

* Die sonstigen Aufwendungen enthalten unter anderem Druck- und Veröffentlichungsgebühren.

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Anleihen									
Abengoa 6.875% 30.04.43 /Pool Regs	6.875	30.04.43	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 435 036.50	0.52
Abq Finance 2.0% 21-06.07.26	2.000	06.07.26	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Abu Dhabi 5.5% 24-30.04.54 Regs	5.500	30.04.54	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Adb 5.75% 24-Perp	5.750	31.12.99	USD	-	2 000 000	-1 000 000	1 000 000	967 478.70	0.35
Adcb 5.5% 23-12.01.29	5.500	12.01.29	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Aeropuerto 4.0% 11.08.41 /P	4.000	11.08.41	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Afrefbk 2.634% 21-17.05.26 Regs	2.634	17.05.26	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 876 960.00	0.68
Afrefbk 3.798% 21-17.05.31 Regs	3.798	17.05.31	USD	3 595 000	-	-3 595 000	-	-	0.00
Afrefbk 4.125% 17-20.06.24	4.125	20.06.24	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Afrefbk 5.25% 18-11.10.23	5.250	11.10.23	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Africa Fina 3.125% 20-16.06.25	3.125	16.06.25	USD	2 000 000	1 000 000	-1 000 000	2 000 000	1 939 370.50	0.70
Africa Fina 3.75% 19-30.10.29	3.750	30.10.29	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 328 479.50	0.48
Africa Fina 4.375% 19-17.04.26	4.375	17.04.26	USD	2 200 000	-	-2 200 000	-	-	0.00
Aia Group 4.95% 23-04.04.33	4.950	04.04.33	USD	1 500 000	200 000	-1 700 000	-	-	0.00
Alfa Bk 5.95% 19-15.04.30	5.950	15.04.30	USD	500 000	-	-	500 000	-	0.00
Alfa Des 4.55% 27.09.51 /Pool	4.550	27.09.51	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	746 544.15	0.27
Alibaba Grp 3.15% 21-09.02.51	3.150	09.02.51	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 286 231.20	0.46
Alibaba Grp 3.6% 15-28.11.24	3.600	28.11.24	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Alibaba Grp 4.2% 17-06.12.47	4.200	06.12.47	USD	2 850 000	-	-2 850 000	-	-	0.00
Alpek 4.25% 19-18.09.29 Regs	4.250	18.09.29	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Amer Movil 3.625% 19-22.04.29	3.625	22.04.29	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Amer Movil 4.375% 19-22.04.49	4.375	22.04.49	USD	1 700 000	-	-1 700 000	-	-	0.00
Amer Movil 6.125% 10-30.03.40	6.125	30.03.40	USD	2 000 000	-	-1 000 000	1 000 000	1 040 330.40	0.37
Angl Ash Hd 3.75% 20-01.10.30	3.750	01.10.30	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Angl Ash Hd 6.5% 10-15.04.40	6.500	15.04.40	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 507 973.55	0.54
Anglo Amer 4.75% 22-16.03.52	4.750	16.03.52	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Anglo Amer 5.50% 02.05.33 Regs	5.500	02.05.33	USD	2 000 000	-	-1 500 000	500 000	490 586.46	0.18
Anglo Amer 5.625% 20-01.04.30	5.625	01.04.30	USD	3 000 000	-	-1 000 000	2 000 000	2 015 966.60	0.73
Antofagasta 5.625% 13.05.32 Regs	5.625	13.05.32	USD	1 500 000	1 500 000	-3 000 000	-	-	0.00
Antofagasta 6.25% 24-02.05.34	6.250	02.05.34	USD	-	3 000 000	-	3 000 000	3 108 975.00	1.12
Anz Bk Nz 5.548% 22-11.08.32	5.548	11.08.32	USD	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Arauco 5.15% 19-29.01.50	5.150	29.01.50	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Banbra 6% 24-18.03.31	6.000	18.03.31	USD	-	1 750 000	-1 750 000	-	-	0.00
Banco 4.375% 11.04.27 Regs	4.375	11.04.27	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 937 149.80	0.70
Banco Bbva 6.2% 24-07.06.34	6.200	07.06.34	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Banco De 3.5% 17-12.10.27	3.500	12.10.27	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Banco Peru 3.25% 19-04.10.26 Regs	3.250	04.10.26	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Bancolumbia 3.0% 20-29.01.25	3.000	29.01.25	USD	1 650 000	-	-1 650 000	-	-	0.00
Bangkok Bk 3.466% 21-23.09.36	3.466	23.09.36	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Bangkok Bk 5.5% 23-21.09.33	5.500	21.09.33	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 993 905.42	0.72
Bank Mandiri 2.0% 21-19.04.26	2.000	19.04.26	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Bank Mandiri 4.75% 20-13.05.25	4.750	13.05.25	USD	700 000	-	-700 000	-	-	0.00
Bank Mandiri 5.50% 23-04.04.26	5.500	04.04.26	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Bank Pekao 5.5% 23-23.11.27	5.500	23.11.27	EUR	-	3 000 000	-1 500 000	1 500 000	1 641 276.61	0.59
Bank Philip 2.50% 19-10.09.24	2.500	10.09.24	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Bbltb 3.733% 19-25.09.34	3.733	25.09.34	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 330 366.32	0.48
Bbva Bancom 4.375% 14-10.04.24	4.375	10.04.24	USD	-	4 300 000	-4 300 000	-	-	0.00
Bbva Bancom 8.45% 23-29.06.38	8.450	29.06.38	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 546 393.50	0.56
Bea 4.0% 20-29.05.30	4.000	29.05.30	USD	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Bgaria-Flir 4.50% 23-27.01.33	4.500	27.01.33	EUR	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Bharat Petr	4.000	08.05.25	USD	1 100 000	-	-1 100 000	-	-	0.00
Bharti Airt 4.375% 15-10.06.25	4.375	10.06.25	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Bimbo Baker 5.375% 24-09.01.36	5.375	09.01.36	USD	-	200 000	-	200 000	195 335.86	0.07

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Bk Hapoalim 3.255% 21-21.01.32	3.255	21.01.32	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Bk Leumi 3.275% 20-29.01.31	3.275	29.01.31	USD	3 000 000	1 500 000	-4 500 000	-	-	0.00
Bk Leumi 7.129% 23-18.07.33	7.129	18.07.33	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Bnk Gosp K 5.375% 22.05.33 Regs	5.375	22.05.33	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Boad 4.7% 19-22.10.31	4.700	22.10.31	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Boad 5% 17-27.07.27 Regs	5.000	27.07.27	USD	2 500 000	2 000 000	-2 500 000	2 000 000	1 914 437.50	0.69
Boc Aviat 2.625% 17.09.30 Regs	2.625	17.09.30	USD	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
Boc Aviat 3.875% 16-27.04.26	3.875	27.04.26	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Boc Aviatio 2.75% 20-02.12.23	2.750	02.12.23	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Boc Aviatio 3% 19-11.09.29	3.000	11.09.29	USD	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
Boc Aviatio 4.875% 23-03.05.33	4.875	03.05.33	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Bprl Intern 4.375% 17-18.01.27	4.375	18.01.27	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Brazil 6.125% 24-15.03.34	6.125	15.03.34	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Brazil 6.125% 24-22.01.32	6.125	22.01.32	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 483 125.00	0.53
Brazil 7.125% 24-13.05.54	7.125	13.05.54	USD	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Bsf Sukuk 5% 24-25.01.29	5.000	25.01.29	USD	-	2 500 000	-2 500 000	-	-	0.00
Buf Ene 7.875% 15.02.39 / Pool	7.875	15.02.39	USD	-	1 750 000	-750 000	1 000 000	1 039 258.00	0.37
Celeo Rede 5.2% 22.06.47 /Pool	5.200	22.06.47	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Cemex 3.875% 21-11.07.31 Regs	3.875	11.07.31	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	882 468.40	0.32
Cemex 9.125% 23-Perp	9.125	31.12.99	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	1 068 551.00	0.39
Cencosud 4.375% 17-17.07.27	4.375	17.07.27	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 923 926.20	0.69
Cencosud 5.15% 15-12.02.25	5.150	12.02.25	USD	3 150 000	-	-3 150 000	-	-	0.00
Cencosud 5.95% 24-28.05.31	5.950	28.05.31	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 009 680.00	0.72
Cencosud 6.625% 15-12.02.45	6.625	12.02.45	USD	1 500 000	1 151 000	-1 500 000	1 151 000	1 183 109.45	0.43
Cerro 4.125% 17-16.08.27 Regs	4.125	16.08.27	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Ceska Spo 4.57% 24-03.07.31	4.570	03.07.31	EUR	-	2 000 000	-	2 000 000	2 137 552.32	0.77
Ceska Spo 4.824% 15.01.30 Regs	4.824	15.01.30	EUR	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Ceska Spo 5.737% 23-08.03.28	5.737	08.03.28	EUR	-	1 500 000	-	1 500 000	1 661 315.66	0.60
Chile 4.125% 23-05.07.34	4.125	05.07.34	EUR	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Chile 4.85% 24-22.01.29	4.850	22.01.29	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
China Cinda 3.0% 21-20.01.31	3.000	20.01.31	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
China O&G 4.70% 21-30.06.26	4.700	30.06.26	USD	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
China Overs 2.45% 21-09.02.26	2.450	09.02.26	USD	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
China Overs 6.375% 13-29.10.43	6.375	29.10.43	USD	-	900 000	-900 000	-	-	0.00
Ck Hutchiso 2.50% 08.05.30 Regs	2.500	08.05.30	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Ck Hutchiso 4.875% 23-21.04.33	4.875	21.04.33	USD	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Ck Hutchiso 5.5% 24-26.04.34	5.500	26.04.34	USD	-	5 000 000	-2 000 000	3 000 000	3 012 377.10	1.09
Cn Life 5.35% (Frn)15.08.33 Regs	5.350	15.08.33	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Coastal Eme 6.5% 24-Perp	6.500	31.12.99	USD	-	800 000	-800 000	-	-	0.00
Cofide 4.75% 15-15.07.25	4.750	15.07.25	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Cofide 5.25% 14-15.07.29	5.250	15.07.29	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Colombia 3.875% 21-15.02.61	3.875	15.02.61	USD	2 000 000	2 500 000	-4 500 000	-	-	0.00
Colombia 8.0% 22-20.04.33	8.000	20.04.33	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Compet Team 3.75% 19-12.03.24	3.750	12.03.24	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Compet Team 4.25% 19-12.03.29	4.250	12.03.29	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Credito 3.125% 20-01.07.30	3.125	01.07.30	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 927 847.60	0.69
Croatia 3.375% 24-12.03.34	3.375	12.03.34	EUR	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Croatia 6% 13-26.01.24	6.000	26.01.24	USD	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Dbs Group 3.30% 20-Perp	3.300	31.12.99	USD	2 500 000	-	-	2 500 000	2 454 375.00	0.88
Deutschland 2.2% 24-15.02.34	2.200	15.02.34	EUR	-	7 000 000	-7 000 000	-	-	0.00
Dp World	6.850	02.07.37	USD	2 500 000	-	-	2 500 000	2 711 926.25	0.98
Ecopetrol 4.125% 14-16.01.25	4.125	16.01.25	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Ecopetrol 7.375% 13-18.09.43	7.375	18.09.43	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Ecopetrol 8.375% 24-19.01.36	8.375	19.01.36	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Ecopetrol 8.875% 23-13.01.33	8.875	13.01.33	USD	2 000 000	3 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
Edo Sukuk L 5.875% 23-21.09.33	5.875	21.09.33	USD	-	2 500 000	-2 500 000	-	-	0.00
Eibk 4.50% 22-15.09.32	4.500	15.09.32	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Eibk 5.125% 23-11.01.33	5.125	11.01.33	USD	600 000	-	-600 000	-	-	0.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Eig Pearl 3.545% 31.08.36 /Pool Regs	3.545	31.08.36	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 719 420.00	0.62
Emaar Sukuk 3.70% 21-06.07.31	3.700	06.07.31	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Emirate20 Frn 2.625% 18.02.25	2.625	18.02.25	USD	1 050 000	-	-1 050 000	-	-	0.00
Emirates Nbdfrn 5.875% 11.10.28	5.875	11.10.28	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Empresa Nac 3.75% 16-05.08.26	3.750	05.08.26	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Empresa Nac 6.15% 23-10.05.33	6.150	10.05.33	USD	200 000	2 800 000	-1 500 000	1 500 000	1 505 080.50	0.54
Ena Master 4% 20-19.05.48 Pool Regs	4.000	19.05.49	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Enersis Chi 4.875% 18-12.06.28	4.875	12.06.28	USD	1 400 000	-	-1 400 000	-	-	0.00
Erste&Steie 4.875% 24-31.01.29	4.875	31.01.29	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	1 090 911.50	0.39
Eximbank 6% 23-16.05.29	6.000	16.05.29	EUR	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Export Impo 5.354% 24-16.05.29 Regs	5.354	16.05.29	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Far East Ho 4.25% 21-26.10.26	4.250	26.10.26	USD	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Fermaca 6.375% 30.03.38 /Pool	6.375	30.03.38	USD	1 583 000	1 500 000	-	3 083 000	2 238 523.88	0.81
Fibria 5.5% 17-17.01.27	5.500	17.01.27	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Flex Ltd 4.875% 19-15.06.29	4.875	15.06.29	USD	1 150 000	-	-1 150 000	-	-	0.00
Flex Ltd 4.875% 20-12.05.30	4.875	12.05.30	USD	1 400 000	-	-1 400 000	-	-	0.00
Flextronics 4.75% 15-15.06.25	4.750	15.06.25	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Formosa	3.375	22.04.25	USD	750 000	-	-750 000	-	-	0.00
Foxcon 2.50% 20-28.10.30	2.500	28.10.30	USD	2 160 000	-	-2 160 000	-	-	0.00
Franshion B 4.25% 19-23.07.29	4.250	23.07.29	USD	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Freeport Id 5.315% 22-14.04.32	5.315	14.04.32	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 940 150.60	0.70
Freeport Id 6.20% 22-14.04.52	6.200	14.04.52	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 481 694.90	0.53
Fresnillo 4.25% 20-02.10.50	4.250	02.10.50	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Gaci First 5.25% 24-29.01.34	5.250	29.01.34	USD	-	4 000 000	-4 000 000	-	-	0.00
Galaxy 2.94% 30.09.40/Pool Regs	2.940	30.09.40	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Galaxy 3.25% 20-30.09.40/Pool	3.250	30.09.40	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 524 495.58	0.55
Galaxy Pipe 2.625% 31.03.36 Pool	2.625	31.03.36	USD	2 500 000	-	-	2 500 000	2 038 841.03	0.73
Galaxy Pipe 2.16% 31.03.34 /Pool	2.160	31.03.34	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 392 462.83	0.50
Gc Treas C 2.98% 21-18.03.31	2.980	18.03.31	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Gc Treas C 5.20% 22-30.03.52	5.200	30.03.52	USD	3 000 000	1 500 000	-4 500 000	-	-	0.00
Genm Capita 3.882% 21-19.04.31	3.882	19.04.31	USD	1 000 000	500 000	-	1 500 000	1 313 154.15	0.47
Gnl Quinter 4.634% 14-29 /Pool	4.634	31.07.29	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Gohl Cap 4.25% 17-24.01.27 Regs	4.250	24.01.27	USD	2 900 000	-	-	2 900 000	2 786 400.65	1.00
Greenko 3.85% 29.03.26 /Pool	3.850	29.03.26	USD	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Greensaif 6.129% 23.02.38 /Pool	6.129	23.02.38	USD	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
Grp Televis 6.125% 15-31.01.46	6.125	31.01.46	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Grupo Energ 4.875% 20-15.05.30 Regs	4.875	15.05.30	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	952 868.40	0.34
Grupo Energ 7.85% 23-09.11.33	7.850	09.11.33	USD	-	1 800 000	-1 800 000	-	-	0.00
Gtl Trade F 7.25% 14-16.04.44	7.250	16.04.44	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Hindustan P 4% 17-12.07.27	4.000	12.07.27	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Hk Land Fin 5.25% 23-14.07.33	5.250	14.07.33	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Hkt Capital 3.0% 22-18.01.32	3.000	18.01.32	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Hkt Capital 3.625% 15-02.04.25	3.625	02.04.25	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Hungary 5.375% 23-12.09.33	5.375	12.09.33	EUR	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Hungary 5.5% 24-26.03.36	5.500	26.03.36	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Hungary 5.50% 22-16.06.34 Regs	5.500	16.06.34	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 457 400.00	0.53
Hunt 6.375% 18-01.06.28 /Pool Regs	6.375	01.06.28	USD	900 000	1 100 000	-2 000 000	-	-	0.00
Hunt Oil Pe 8.55% 23-18.09.33 /Pool	8.550	18.09.33	USD	-	4 500 000	-2 000 000	2 500 000	2 707 937.50	0.98
Hut Wha Int 7.45% 24.11.33 Regs	7.450	24.11.33	USD	500 000	1 500 000	-2 000 000	-	-	0.00
Hysan 2.82% 19-04.09.29	2.820	04.09.29	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Hyund Cap 2.375% 20-15.10.27	2.375	15.10.27	USD	1 670 000	-	-1 670 000	-	-	0.00
Hyund Cap 5.60% 23-30.03.28	5.600	30.03.28	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Hyund Cap 5.80% 23-01.04.30 Regs	5.800	01.04.30	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Hyundai Mtr 1.75% 21-06.05.26	1.750	06.05.26	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Icici Bk 3.8% 17-14.12.27 Regs	3.800	14.12.27	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Icici Bk D 4% 16-18.03.26	4.000	18.03.26	USD	1 700 000	-	-1 700 000	-	-	0.00
Ind Penoles 4.15% 19-12.09.29 Regs	4.150	12.09.29	USD	3 000 000	-	-2 000 000	1 000 000	932 170.90	0.34
Ind Penoles 4.75% 20-06.08.50	4.750	06.08.50	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	773 206.40	0.28

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Indian Rail 3.249% 20-13.02.30	3.249	13.02.30	USD	500 000	1 500 000	-	2 000 000	1 799 742.56	0.65
Indian Rail 3.95% 20-13.02.50	3.950	13.02.50	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Indofood 3.398% 21-09.06.31	3.398	09.06.31	USD	3 000 000	1 400 000	-2 900 000	1 500 000	1 308 798.00	0.47
Indofood 4.745% 21-09.06.51	4.745	09.06.51	USD	-	2 000 000	-1 000 000	1 000 000	830 665.00	0.30
Indofood 4.805% 21-27.04.52	4.805	27.04.52	USD	1 500 000	-	-500 000	1 000 000	830 100.00	0.30
Indonesia 4.20% 20-15.10.50	4.200	15.10.50	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Indonesia 4.7% 24-10.02.34	4.700	10.02.34	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Indonesia 4.85% 23-11.01.33	4.850	11.01.33	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Indonesia 5.65% 23-11.01.53	5.650	11.01.53	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Interchile 4.50% 21-30.06.56	4.500	30.06.56	USD	1 500 000	1 500 000	-3 000 000	-	-	0.00
Inver Cmpc 6.125% 23-23.06.33	6.125	23.06.33	USD	2 000 000	2 000 000	-2 000 000	2 000 000	2 037 947.20	0.73
Inversiones 4.75% 14-15.09.24	4.750	15.09.24	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Israel Chem 6.375% 18-31.05.38	6.375	31.05.38	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Kazmunay 5.375% 18-24.04.30 Regs	5.375	24.04.30	USD	2 700 000	-	-2 700 000	-	-	0.00
Kazmunay 6.375% 18-24.10.48 Regs	6.375	24.10.48	USD	1 000 000	1 000 000	-	2 000 000	1 886 042.50	0.68
Kazmunaygas 4.75% 19.04.27 Regs	4.750	19.04.27	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	968 199.50	0.35
Kazmunaygas 5.75% 19.04.47 Regs	5.750	19.04.47	USD	3 500 000	-	-1 000 000	2 500 000	2 181 937.50	0.79
Kbank Hk 5.275% 20-Perp	5.275	31.12.99	USD	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Kmg Fin 3.50% 20-14.04.33	3.500	14.04.33	USD	1 000 000	1 000 000	-	2 000 000	1 641 190.00	0.59
Korea Gas 6.25% 12-20.01.42	6.250	20.01.42	USD	500 000	-	-	500 000	563 153.35	0.20
Kyobo Life 5.90% 22-Perp	5.900	31.12.99	USD	2 140 000	-	-	2 140 000	2 149 351.80	0.77
Latvia 5.125% 24-30.07.34 Regs	5.125	30.07.34	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	986 261.75	0.36
Lima Me 5.875% 05.07.34 /Pool	5.875	05.07.34	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	845 925.95	0.30
Lima Metro 4.35% 19-05.04.36 Regs	4.350	05.04.36	USD	250 000	1 000 000	-1 250 000	-	-	0.00
Lithuania 3.5% 24-03.07.31	3.500	03.07.31	EUR	-	2 200 000	-	2 200 000	2 341 275.49	0.84
Lithuania 3.5% 24-13.02.34	3.500	13.02.34	EUR	-	2 400 000	-2 400 000	-	-	0.00
Longfor Ppt 3.95% 19-16.09.29	3.950	16.09.29	USD	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Mashreqbk 7.875% 22-24.02.33	7.875	24.02.33	USD	1 300 000	1 000 000	-	2 300 000	2 432 376.50	0.88
Mauritius C 7.95% 23-26.04.28	7.950	26.04.28	USD	2 000 000	2 000 000	-2 000 000	2 000 000	2 138 120.00	0.77
Meituan Dnp 3.05% 20-28.10.30	3.050	28.10.30	USD	2 000 000	2 000 000	-4 000 000	-	-	0.00
Metro Bk & 5.375% 24-06.03.29	5.375	06.03.29	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 503 705.00	0.54
Metro Bk & 5.5% 24-06.03.34	5.500	06.03.34	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Mexico Airp 5.5% 17-31.07.47 Regs	5.500	31.07.47	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Mexico Cete 4.490% 24-25.05.32	4.490	25.05.32	EUR	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Mexico Cete 6.338% 23-04.05.53	6.338	04.05.53	USD	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Mexico Cete 6.35% 23-09.02.35	6.350	09.02.35	USD	2 000 000	2 000 000	-4 000 000	-	-	0.00
Mfb Hd Bk 6.50% 23-29.06.28	6.500	29.06.28	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	2 037 200.00	0.73
Mirae Asset Sec 5.875% 24-26.01.27	5.875	26.01.27	USD	-	200 000	-	200 000	200 041.10	0.07
Mirae Asset Sec 6.875% 23-26.07.26	6.875	26.07.26	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 038 057.40	0.73
Misc Cap 3.75% 22-06.04.27 Regs	3.750	06.04.27	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Mit Uf 5.063% (Frn) 22-12.09.25	5.063	12.09.25	USD	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Mivivi 4.265% 22-12.04.27 Regs	4.265	12.04.27	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Morocco 4.0% 20-15.12.50	4.000	15.12.50	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Morocco 5.95% 23-08.03.28 Regs	5.950	08.03.28	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Muang Thai 3.552% 21-27.01.37	3.552	27.01.37	USD	1 950 000	1 550 000	-1 462 000	2 038 000	1 921 895.14	0.69
Myriad Intl 4.85% 17-06.07.27 Regs	4.850	06.07.27	USD	3 075 000	-	-	3 075 000	2 992 832.93	1.08
Nakilat 6.067% 06-31.12.33 Regs	6.067	31.12.33	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Nat Kazak 3.25% 18-05.12.23	3.250	05.12.23	CHF	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Nissan Moto 4.345% 20-17.09.27	4.345	17.09.27	USD	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Nova Kbm 4.75% 24-03.04.28	4.750	03.04.28	EUR	-	2 000 000	-	2 000 000	2 153 724.50	0.78
Nova Ljubl 4.5% 24-29.05.30	4.500	29.05.30	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	1 067 893.84	0.38
Nova Ljubl 6.875% 24-24.01.34	6.875	24.01.34	EUR	-	1 200 000	-	1 200 000	1 343 138.54	0.48
Ocbc 1.832% 20-10.09.30	1.832	10.09.30	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Ocbc 4.25% 14-19.06.24	4.250	19.06.24	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Ocbc 5.52% 24-21.05.34	5.520	21.05.34	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	1 005 495.00	0.36
Office Cher 5.125% 21-23.06.51	5.125	23.06.51	USD	1 000 000	1 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Office Cher 6.75% 24-02.05.34	6.750	02.05.34	USD	-	2 200 000	-1 000 000	1 200 000	1 232 538.00	0.44
Office Cher 6.875% 14-25.04.44	6.875	25.04.44	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Office Cher 7.5% 02.05.54 Regs	7.500	02.05.54	USD	-	3 000 000	-1 000 000	2 000 000	2 042 800.00	0.74
Ooredoo Int	3.750	22.06.26	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Ooredoo Int 2.625% 21-08.04.31	2.625	08.04.31	USD	1 000 000	1 500 000	-2 500 000	-	-	0.00
Otp Bank 4.75% 24-12.06.28	4.750	12.06.28	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	1 070 072.71	0.39
Otp Bank 7.50% 23-25.05.27	7.500	25.05.27	USD	2 500 000	-	-	2 500 000	2 565 130.00	0.92
Panama 3.75% 15-16.03.25	3.750	16.03.25	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Panama 6.40% 22-14.02.35	6.400	14.02.35	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Panama 6.875% 23-31.01.36	6.875	31.01.36	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Pertamina 2.30% 21-09.02.31	2.300	09.02.31	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Pertamina 5.625% 20.05.43 Regs	5.625	20.05.43	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 930 487.50	0.70
Peru 3.60% 21-15.01.72	3.600	15.01.72	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Pingan Real 3.45% 21-29.07.26	3.450	29.07.26	USD	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Pko Bank 4.5% 24-18.06.29	4.500	18.06.29	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	1 072 489.51	0.39
Pko Bank 4.5% 24-27.03.28	4.500	27.03.28	EUR	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Pla Adm 4.962% 19-18.07.29 Regs	4.962	18.07.29	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Poland 3.625% 24-11.01.34	3.625	11.01.34	EUR	-	3 500 000	-1 500 000	2 000 000	2 124 739.02	0.77
Poland 4.875% 23-04.10.33	4.875	04.10.33	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Poland 5.125% 24-18.09.34	5.125	18.09.34	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Poland 5.5% 24-18.03.54	5.500	18.03.54	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Pow Fin 3.9% 19-16.09.29	3.900	16.09.29	USD	-	300 000	-	300 000	278 066.61	0.10
Prosus 3.061% 21-13.07.31 Regs	3.061	13.07.31	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Prosus 3.68% 20-21.01.30	3.680	21.01.30	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	889 681.63	0.32
Prosus 3.832% 20-08.02.51 Regs	3.832	08.02.51	USD	3 000 000	1 500 000	-2 500 000	2 000 000	1 308 933.58	0.47
Prosus 4.027% 20-03.08.50 Regs	4.027	03.08.50	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 361 262.04	0.49
Prosus 4.193% 22-19.01.32	4.193	19.01.32	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 768 388.76	0.64
Prudential 2.95% 21-03.11.33	2.950	03.11.33	USD	5 000 000	-	-1 000 000	4 000 000	3 558 033.00	1.28
Psa Trea 2.25% 20-30.04.30	2.250	30.04.30	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Pt Bk Negar 5.28% 24-05.04.29	5.280	05.04.29	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Pt Pertamina 6% 12-03.05.42 Regs	6.000	03.05.42	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 508 185.50	0.54
Pttep Treas 3.903% 19-06.12.59	3.903	06.12.59	USD	700 000	-	-700 000	-	-	0.00
Qatar 5.103% 18-23.04.48 Regs	5.103	23.04.48	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Qnb Fin 1.375% 21-26.01.26	1.375	26.01.26	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Qnb Fin 2.75% 20-12.02.27	2.750	12.02.27	USD	700 000	-	-700 000	-	-	0.00
Qnb Fin 3.5% 19-28.03.24	3.500	28.03.24	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Qnb Fin 4.875% 24-30.01.29	4.875	30.01.29	USD	-	4 000 000	-4 000 000	-	-	0.00
Qtel Int Fi 4.5% 13-31.01.43	4.500	31.01.43	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Raiffeisen 5.15% 24-23.05.30	5.150	23.05.30	EUR	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Raiffeisenb 4.959% 24-05.06.30	4.959	05.06.30	EUR	-	2 000 000	-	2 000 000	2 144 649.34	0.77
Raizn Fuel 5.3% 17-20.01.27 Regs	5.300	20.01.27	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Raizn Fuel 6.45% 05.03.34 Regs	6.450	05.03.34	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 032 660.00	0.73
Raizn Fuel 6.95% 24-05.03.54	6.950	05.03.54	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 526 988.00	0.55
Rakfunding 4.125% 19-09.04.24	4.125	09.04.24	USD	-	2 300 000	-2 300 000	-	-	0.00
Rec Ltd 5.25% 18-13.11.23	5.250	13.11.23	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Reliance 3.625% 22-12.01.52 Regs	3.625	12.01.52	USD	1 870 000	-	-1 870 000	-	-	0.00
Reliance In 2.875% 22-12.01.32	2.875	12.01.32	USD	3 500 000	-	-	3 500 000	2 973 064.40	1.07
Rep.Panama 7.125% 05-29.01.26	7.125	29.01.26	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 039 999.20	0.74
Riyad Bank 3.174% 20-25.02.30	3.174	25.02.30	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Romania 5.375% 24-22.03.31	5.375	22.03.31	EUR	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Romania 7.125% 23-17.01.33 Regs	7.125	17.01.33	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Rural Elec 3.50% 19-12.12.24	3.500	12.12.24	USD	850 000	-	-850 000	-	-	0.00
Rural Elec 5.625% 23-11.04.28	5.625	11.04.28	USD	2 000 000	1 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Ruwais Pow 6% 13-31.08.36 /Pool	6.000	31.08.36	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	2 027 180.00	0.73
Sabic Ca 4.5% 18-10.10.28 Regs	4.500	10.10.28	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Samba Fdg 2.75% 19-02.10.24	2.750	02.10.24	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Sands China 3.1% 22-08.03.29	2.850	08.03.29	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 761 025.20	0.63
Sands China 3.75% 22-08.08.31	3.250	08.08.31	USD	-	4 000 000	-	4 000 000	3 372 405.60	1.22
Sands China 5.125% 18-08.08.25	5.125	08.08.25	USD	-	2 500 000	-2 500 000	-	-	0.00
Sands China 5.4% 18-08.08.28	5.400	08.08.28	USD	-	4 000 000	-	4 000 000	3 919 435.20	1.41

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Santander 5.375% 20-17.04.25 Regs	5.375	17.04.25	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Santander 5.95% 18-1.10.28 Regs	7.525	01.10.28	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 086 424.00	0.75
Santos Fin 3.649% 21-29.04.31	3.649	29.04.31	USD	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Saud Arabia 4.875% 23-18.07.33	4.875	18.07.33	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Saudi Oil 2.25% 20-24.11.30	2.250	24.11.30	USD	-	4 000 000	-2 000 000	2 000 000	1 686 713.50	0.61
Saudi Oil 3.25% 20-24.11.50 Regs	3.250	24.11.50	USD	1 650 000	2 000 000	-1 650 000	2 000 000	1 346 625.00	0.49
Saudi Oil 3.5% 19-16.04.29	3.500	16.04.29	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Saudi Oil 4.25% 19-16.04.39 Regs	4.250	16.04.39	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Sb Capital 5.25% 13-23.05.23	5.250	23.05.23	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	-	0.00
Scentr 4.375% 20-28.05.30 Regs	4.375	28.05.30	USD	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Serbia T-Bo 1.65% 21-03.03.33	1.650	03.03.33	EUR	-	1 500 000	-	1 500 000	1 206 803.90	0.43
Serbia T-Bo 6.25% 23-26.05.28	6.250	26.05.28	USD	1 250 000	1 500 000	-1 250 000	1 500 000	1 519 837.50	0.55
Serbia T-Bo 6.50% 23-26.09.33	6.500	26.09.33	USD	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Shinhan Bk	3.875	24.03.26	USD	2 300 000	-	-2 300 000	-	-	0.00
Shinhan Bk 5.75% 24-15.04.34	5.750	15.04.34	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 979 416.64	0.71
Shriram Fin 6.625% 24-22.04.27	6.625	22.04.27	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	1 001 772.00	0.36
Sigma 4.125% 16-02.05.26	4.125	02.05.26	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Singapore Tele. 7.375% 01-31	7.375	01.12.31	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Singtel Grp 2.375% 16-03.10.26	2.375	03.10.26	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Sk Battery 4.875% 24-23.01.27	4.875	23.01.27	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Sk Brdband 4.875% 23-28.06.28	4.875	28.06.28	USD	500 000	200 000	-700 000	-	-	0.00
Sk Hynix 1.50% 21-19.01.26	1.500	19.01.26	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Sk Hynix 6.50% 23-17.01.33	6.500	17.01.33	USD	2 000 000	400 000	-2 400 000	-	-	0.00
Sk On Co Lt 5.375% 23-11.05.26	5.375	11.05.26	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Slovenska S 5.375% 23-04.10.28	5.375	04.10.28	EUR	-	2 000 000	-	2 000 000	2 203 492.28	0.79
Snb Sukuk L 5.129% 24-27.02.29	5.129	27.02.29	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Softbank 4.625% 21-06.07.28	4.625	06.07.28	USD	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Soquimich 6.5% 07.11.33 Regs	6.500	07.11.33	USD	-	4 000 000	-1 500 000	2 500 000	2 613 672.50	0.94
South Africa 4.665% 12-17.01.24	4.665	17.01.24	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
St Bk India 4.375% 24.01.24 Regs	4.375	24.01.24	USD	1 705 000	-	-1 705 000	-	-	0.00
St Bk India 4.875% 23-05.05.28	4.875	05.05.28	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
St Bk India 5% 24-17.01.29	5.000	17.01.29	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
St Marys 5.75% 16-28.01.27	5.750	28.01.27	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Star Ener 4.85%14.10.38 /Pool	4.850	14.10.38	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	917 692.20	0.33
Std Chart 3.516% 19-12.02.30	3.516	12.02.30	USD	3 725 000	-	-3 725 000	-	-	0.00
Std Chart 5.905% 24-14.05.35	5.905	14.05.35	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 987 412.08	0.72
Std Chart 6.17% 23-09.01.27	6.170	09.01.27	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Std Chart 7.767% 22-16.11.28	7.767	16.11.28	USD	4 000 000	-	-1 000 000	3 000 000	3 194 747.40	1.15
Std Chart 7.776% 22-16.11.25	7.776	16.11.25	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	2 013 685.40	0.73
Suam Fin 4.875% 14-17.04.24	4.875	17.04.24	USD	-	1 775 000	-1 775 000	-	-	0.00
Summit Di 2.875% 12.08.31 Regs	2.875	12.08.31	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Sunshine 4.5% 16-20.04.26	4.500	20.04.26	USD	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Suzano Aust 2.50% 21-15.09.28	2.500	15.09.28	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Suzano Aust 3.125% 21-15.01.32	3.125	15.01.32	USD	-	3 000 000	-2 500 000	500 000	409 651.95	0.15
Suzano Aust 5% 19-15.01.30	5.000	15.01.30	USD	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Suzano Aust 7% 17-16.03.47 Regs	7.000	16.03.47	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Suzano Intl Fin 5.5% 17.01.27	5.500	17.01.27	USD	-	3 000 000	-1 500 000	1 500 000	1 491 379.95	0.54
Sweihan 3.625% 31.01.49 /Pool	3.625	31.01.49	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 523 217.58	0.55
Tencent 3.29% 20-03.06.60 Regs	3.290	03.06.60	USD	2 000 000	-	-	-	1 248 442.94	0.45
Tencent Hol 3.24% 20-03.06.50	3.240	03.06.50	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Thaioil Trs 3.50% 19-17.10.49	3.500	17.10.49	USD	1 550 000	-	-	1 550 000	1 051 951.26	0.38
Thaioil Trs 3.75% 20-18.06.50	3.750	18.06.50	USD	1 000 000	1 577 000	-2 577 000	-	-	0.00
Thaioil Trs 4.875% 18-23.01.43	4.875	23.01.43	USD	1 200 000	-	-	1 200 000	1 045 054.25	0.38
Tms Issuer 5.78% 23.08.32/Pool	5.780	23.08.32	USD	1 300 000	-	-1 300 000	-	-	0.00
Tower B Inf 2.75% 21-20.01.26	2.750	20.01.26	USD	2 700 000	-	-	2 700 000	2 575 557.00	0.93
Tower B Inf 4.25% 20-21.01.25	4.250	21.01.25	USD	500 000	-	-	500 000	495 812.50	0.18
Trans Peru 4.25% 30.04.28 Regs	4.250	30.04.28	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Transport 5.55% 18-01.11.28 Regs	5.550	01.11.28	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Trust 4.869% 20-15.01.30	4.869	15.01.30	USD	500 000	1 500 000	-2 000 000	-	-	0.00
Trust F 5.25% 14-15.12.24 Regs	5.250	15.12.24	USD	2 000 000	3 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
Tsmc Arizon 2.50% 21-25.10.31	2.500	25.10.31	USD	4 000 000	-	-4 000 000	-	-	0.00
Tsmc Arizon 3.25% 21-25.10.51	3.250	25.10.51	USD	-	2 500 000	-1 500 000	1 000 000	745 764.69	0.27
Tsmc Global 1.375% 20-28.09.30	1.375	28.09.30	USD	3 000 000	200 000	-	3 200 000	2 594 802.50	0.93
Tsmc Global 2.25% 21-23.04.31	2.250	23.04.31	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 691 085.04	0.61
Uobsp 1.75% 20-16.03.31	1.750	16.03.31	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Uobsp 3.75% 19-15.04.29 Regs	3.750	15.04.29	USD	700 000	-	-700 000	-	-	0.00
Uobsp 3.875% 17-Perp	3.875	31.12.99	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Uobsp Frn 22-07.10.32	0.000	07.10.32	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Uruguay 5.1% 14-18.06.50 /Pool	5.100	18.06.50	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Usa 3.625% 23-15.05.53 /Tbo	3.625	15.05.53	USD	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Usa 3.875% 23-15.08.33 Tbo	3.875	15.08.33	USD	-	6 000 000	-6 000 000	-	-	0.00
Usa 4% 24-15.02.34 /Tbo	4.000	15.02.34	USD	-	10 000 000	-10 000 000	-	-	0.00
Usa 4.25% 24-15.02.54 /Tbo	4.250	15.02.54	USD	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Usa 4.375% 24-15.05.34 /Tbo	4.375	15.05.34	USD	-	4 000 000	-4 000 000	-	-	0.00
Usa 4.5% 24-31.05.29 /Tbo	4.500	31.05.29	USD	-	5 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
Usa 4.625% 22-15.02.52	4.625	15.05.54	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Usa 4.875% 24-30.04.26 /Tbo	4.875	30.04.26	USD	-	15 000 000	-15 000 000	-	-	0.00
Vesta 3.625% 21-13.05.31	3.625	13.05.31	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 265 252.10	0.46
Vietnam 4.8% 14-19.11.24	4.800	19.11.24	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Votorantim 7.25% 11-05.04.41	7.250	05.04.41	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	1 097 740.00	0.40
Vtb Cap 6.95% 12-17.10.22	6.950	17.10.22	USD	200 000	-	-	200 000	-	0.00
Weibo 3.375% 20-08.07.30	3.375	08.07.30	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 750 453.20	0.63
Woori Bk	4.750	30.04.24	USD	3 000 000	200 000	-3 200 000	-	-	0.00
Woori Bk 4.75% 24-24.01.27 Regs	4.750	24.01.27	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Xiaomi Best 2.875% 21-14.07.31	2.875	14.07.31	USD	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
								206 110 773.08	74.26

Schatzwechsel

Deutschland 0% 23-19.06.24 Tb		19.06.24	EUR	-	23 000 000	-23 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-09.05.24 Tb		09.05.24	USD	-	10 000 000	-10 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-13.06.24 Tb		13.06.24	USD	-	36 000 000	-36 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-16.11.23 Tb		16.11.23	USD	-	20 000 000	-20 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 24-29.08.24 Tb		29.08.24	USD	-	8 000 000	-	8 000 000	7 931 133.92	2.86
								7 931 133.92	2.86

Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

214 041 907.00 77.12

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Anleihen

Abq Finance 1.875% 20-08.09.25	1.875	08.09.25	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Abq Finance 3.125% 19-24.09.24	3.125	24.09.24	USD	2 300 000	-	-2 300 000	-	-	0.00
Adcb 4.50% 22-14.09.27	4.500	14.09.27	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Aerodom 7% 24-30.06.34	7.000	30.06.34	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	1 013 700.90	0.37
Aia Group 5.375% 24-05.04.34	5.375	05.04.34	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 956 327.62	0.71
Al Rajhi Su 6.375% 24-Perp	6.375	31.12.99	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 521 067.50	0.55
Aldar Inves 4.875% 23-24.05.33	4.875	24.05.33	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Anglo 4.75% 22-16.03.52 144A	4.750	16.03.52	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Arauco 4.20% 19-29.01.30	4.200	29.01.30	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Banco Peru 4.0% 20-08.07.30	4.000	08.07.30	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 942 316.84	0.70
Banco Peru 7.625% 24-16.01.34	7.625	16.01.34	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 590 600.00	0.57
Bbl Tb 9.025% 97-15.03.29	9.025	15.03.29	USD	2 500 000	-	-	2 500 000	2 847 433.75	1.03
Bbva 5.862% 22-14.09.26	5.862	14.09.26	USD	-	2 600 000	-2 600 000	-	-	0.00
Bdo Unibank 2.125% 20-13.01.26	2.125	13.01.26	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Bea 4.875% 22-22.04.32	4.875	22.04.32	USD	-	1 150 000	-1 150 000	-	-	0.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Bea 6.75% 24-27.06.34	6.750	27.06.34	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	994 080.01	0.36
Bk Leumi 5.125% 22-27.07.27	5.125	27.07.27	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Boc Aviatio 1.625% 21-29.04.24	1.625	29.04.24	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Boc Aviatio 1.75% 21-21.01.26	1.750	21.01.26	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Boc Aviatio 3.25% 20-29.04.25 Regs	3.250	29.04.25	USD	1 700 000	-	-1 700 000	-	-	0.00
Boc Aviatio 5.25% 24-14.01.30	5.250	14.01.30	USD	-	2 500 000	-2 500 000	-	-	0.00
Boc Aviatio 5.75% 23-09.11.28	5.750	09.11.28	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 040 323.80	0.74
Cathaylife 5.95% 24-05.07.34	5.950	05.07.34	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 006 738.80	0.72
Ck Hutchiso 2.75% 19-06.09.29	2.750	06.09.29	USD	950 000	-	-950 000	-	-	0.00
Cofide 5.95% 24-30.04.29 Regs	5.950	30.04.29	USD	-	3 000 000	-1 500 000	1 500 000	1 502 595.00	0.54
Colombia 8% 23-14.11.35	8.000	14.11.35	USD	-	2 400 000	-2 400 000	-	-	0.00
Colombia 8.75% 23-14.11.53	8.750	14.11.53	USD	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Cometa 6.375% 24.04.35 /Pool	6.375	24.04.35	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Credito 2.875% 21-14.10.31	2.875	14.10.31	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Credito 8.75% 24-Perp	8.750	31.12.99	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 572 337.50	0.57
Ctr Plaz Dv 3.85% 20-17.07.25	3.850	14.07.25	USD	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Dbs Group 1.822% 21-10.03.31	1.822	10.03.31	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Dp World Cr 5.5% 23-13.09.33	5.500	13.09.33	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Empresa De 3.83% 21-14.09.61	3.830	14.09.61	USD	3 000 000	2 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
Enn Energy 2.625% 20-17.09.30 Regs	2.625	17.09.30	USD	1 500 000	1 000 000	-2 500 000	-	-	0.00
Far East Ho 6.625% 24-16.04.27	6.625	16.04.27	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
First 6.32% 23-04.04.34 Regs	6.320	04.04.34	USD	-	5 000 000	-3 500 000	1 500 000	1 531 410.00	0.55
Gs-Caltex 5.375% 23-07.08.28	5.375	07.08.28	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 005 534.60	0.72
Hdfc Bk 5.686% 23-02.03.26	5.686	02.03.26	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Hk Mtg Co 4.875% 23-13.09.28	4.875	13.09.28	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Hyundai Car 5.75% 24-24.04.29	5.750	24.04.29	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Inver Cmpc 3.85% 20-13.01.30	3.850	13.01.30	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	914 239.70	0.33
Israel Dis 5.375% 23-26.01.28	5.375	26.01.28	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Kallpa 4.875% 16-24.05.26	4.875	24.05.26	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Kdb 2.0% 21-25.10.31	2.000	25.10.31	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Kfh Sukuk C 5.011% 17.01.029	5.011	17.01.29	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Khazanah Ca 4.876% 23-01.06.33	4.876	01.06.33	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Korea Gas 4.875% 23-05.07.28	4.875	05.07.28	USD	2 500 000	1 000 000	-3 500 000	-	-	0.00
Korea Gas 5% 24-08.07.29	5.000	08.07.29	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	996 550.50	0.36
Korearehabn 4.125% 22-20.04.27	4.125	20.04.27	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Lg Energy S 5.5% 24-02.07.34	5.500	02.07.34	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 470 569.12	0.53
Maf Glb Sec 7.875% 22-Perp	7.875	31.12.99	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	2 051 000.00	0.74
Majid Al Fu 5.0% 23-01.06.33	5.000	01.06.33	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Masdar Abu 4.875% 23-25.07.33	4.875	25.07.33	USD	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Misc Cap Two 3.625% 22-06.04.25	3.625	06.04.25	USD	-	1 200 000	-1 200 000	-	-	0.00
Nanyang Com 3.8% 19-20.11.29	3.800	20.11.29	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Nbk Spc 5.5% 24-06.06.30 Regs	5.500	06.06.30	USD	-	4 000 000	-2 000 000	2 000 000	2 020 777.40	0.73
Ocbc 4.602% 22-15.06.32	4.602	15.06.32	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Pldt 2.50% 20-23.01.31	2.500	23.01.31	USD	2 500 000	-	-	2 500 000	2 101 955.00	0.76
Pluspetrol 6.24% 24-03.07.36	6.240	03.07.36	USD	-	1 200 000	-	1 200 000	1 199 828.40	0.43
Pow Fin 4.50% 19-18.06.29	4.500	18.06.29	USD	1 650 000	-	-	1 650 000	1 580 100.56	0.57
Promigas/Ga 3.75% 19-16.10.29 Regs	3.750	16.10.29	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 364 127.30	0.49
Ptt Treasur 4.50% 19-25.10.42	4.500	25.10.42	USD	2 500 000	-	-	2 500 000	2 173 892.50	0.78
Pttep Treas 2.993% 20-15.01.30	2.993	15.01.30	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 342 588.65	0.48
Qib Sukuk Frn 20-07.02.25	6.947	07.02.25	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 511 692.50	0.54
Saudi Elec 5.684% 23-11.04.53	5.684	11.04.53	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Shinhan Crd 5.5% 24-12.03.29	5.500	12.03.29	USD	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Singtel Grp 1.875% 20-10.06.30	1.875	10.06.30	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Sk Hynix 2.375% 21-19.01.31	2.375	19.01.31	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	825 266.28	0.30
Sk Telecom 6.625% 07-20.07.27	6.625	20.07.27	USD	800 000	200 000	-	1 000 000	1 038 682.70	0.37
St Marys 5.75% 24-02.04.34	5.750	02.04.34	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 965 000.00	0.71
Std Chart 6.187% 23-06.07.27	6.187	06.07.27	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Std Chart 6.296% 23-06.07.34	6.296	06.07.34	USD	3 000 000	-	-2 000 000	1 000 000	1 033 766.70	0.37

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Tatra Banka 4.971% 24-29.04.30	4.971	29.04.30	EUR	-	1 100 000	-	1 100 000	1 192 500.32	0.43
Tencent Hol 2.39% 20-03.06.30 Regs	2.390	03.06.30	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Transmanta 4.7% 19-16.04.34	4.700	16.04.34	USD	1 600 000	1 000 000	-	2 600 000	2 447 100.76	0.88
Trinidad & 6.4% 24-26.06.34	6.400	26.06.34	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	993 380.91	0.36
Uae Intl Bo 4.857% 24-02.07.34	4.857	02.07.34	USD	-	3 000 000	-	3 000 000	2 993 283.00	1.08
Union 2.125% 20-22.10.25	2.125	22.10.25	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Westwood Gr 3.80% 21-20.01.31	3.800	20.01.31	USD	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Yinson 8.947% 24-31.07.42 /Pool Regs	8.947	31.07.42	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	1 010 500.00	0.36
Zg O P&C 3.50% 20-08.03.26	3.500	08.03.26	USD	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
								54 751 268.62	19.73
Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere								54 751 268.62	19.73
SUMME WERTPAPIERBESTAND								268 793 175.62	96.85
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								19 093 013.49	6.88
Sonstige Passiven								-10 337 861.91	-3.73
GESAMTNETTOVERMÖGEN								277 548 327.20	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
-------------	---	------------------------	---------	------------------------------	--------	-----------	------------------------------	---------------------	------------------------------

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

Aktien

3Sbio Inc			HKD	210 000	21 000	-231 000	-	-	0.00
Abb Ltd India			INR	-	4 066	-1 339	2 727	277 670.97	0.79
Accton Technology Corp			TWD	22 000	6 000	-13 000	15 000	256 618.13	0.73
Adani Green Energy Ltd			INR	7 000	5 000	-12 000	-	-	0.00
Adani Tot Rgr			INR	4 000	-	-4 000	-	-	0.00
Advantech Co Ltd			TWD	17 000	3 697	-20 697	-	-	0.00
Airtac International Group			TWD	-	8 000	-2 000	6 000	182 730.60	0.52
Alibaba Group Holding Ltd			HKD	118 300	-	-118 300	-	-	0.00
Alibaba Healt Info Technology			HKD	351 000	-	-351 000	-	-	0.00
Ambev Sa			BRL	-	65 600	-65 600	-	-	0.00
Amorepacific Corp			KRW	1 600	773	-2 373	-	-	0.00
Anglo American Platinum Ltd			ZAR	2 500	-	-2 500	-	-	0.00
Apollo Hosp			INR	2 500	-	-2 500	-	-	0.00
Ashok Leyland Ltd /Demat.			INR	-	113 317	-10 090	103 227	299 435.19	0.85
Asian Paints			INR	19 000	2 388	-6 458	14 930	522 270.27	1.49
Astral Poly Technik Ltd Vs			INR	-	10 548	-1 405	9 143	261 037.71	0.74
Au Small Finance Bank Ltd			INR	-	24 502	-24 502	-	-	0.00
Axis Bank Ltd			INR	17 500	16 849	-34 349	-	-	0.00
B3 Sa - Brasil Bolsa Balcao			BRL	69 900	66 174	-43 110	92 964	171 385.52	0.49
Baidu Rg-A			HKD	-	26 750	-26 750	-	-	0.00
Bajaj Finance Ltd			INR	1 940	932	-369	2 503	213 580.18	0.61
Banco Actinver 14 Cert Bursa			MXN	-	64 446	-8 309	56 137	183 096.01	0.52
Banco Do Brasil Sa			BRL	31 000	-	-31 000	-	-	0.00
Bandhan Bank Ltd			INR	-	127 700	-27 446	100 254	244 993.68	0.70
Bco Bradesco Sa /Pref.			BRL	52 000	-	-52 000	-	-	0.00
Beigene Ltd			HKD	-	15 500	-15 500	-	-	0.00
Bharti Airtel Ltd /Demat			INR	-	34 326	-20 091	14 235	246 508.17	0.70
Bid Corporation Limited			ZAR	8 900	1 150	-10 050	-	-	0.00
Bidvest Group Ltd			ZAR	14 800	-	-14 800	-	-	0.00
Big Hit Enter Rg			KRW	-	1 477	-132	1 345	197 735.18	0.56
Boc Aviation Pte Ltd			HKD	-	25 000	-25 000	-	-	0.00
Bosideng Internation. Hldg Ltd			HKD	-	644 000	-198 000	446 000	278 201.01	0.79
Byd Company Limited -H-			HKD	6 500	3 000	-1 500	8 000	237 723.90	0.68
Byd Electronic Co Ltd			HKD	-	73 000	-9 000	64 000	319 697.66	0.91
Capitec Bank Holdings Limited			ZAR	-	1 855	-1 855	-	-	0.00
Cathay Financial Holding			TWD	129 000	156 000	-143 000	142 000	258 251.85	0.74
Chailease			TWD	35 280	32 000	-67 280	-	-	0.00
Chang Hwa Commercial Bank			TWD	340 000	43 500	-383 500	-	-	0.00
China Development Fin. Hld Co			TWD	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
China Everbright Intl Ltd			HKD	487 000	49 000	-536 000	-	-	0.00
China Galaxy Securities -H-			HKD	-	220 000	-220 000	-	-	0.00
China Lesso Group Holdings Ltd			HKD	309 000	-	-309 000	-	-	0.00
China Literature Ltd 144A /Regs			HKD	43 800	-	-43 800	-	-	0.00
China Medical System Holdings			HKD	120 000	16 000	-136 000	-	-	0.00
China Merchants Bank -H-			HKD	-	61 000	-8 000	53 000	240 650.62	0.69
China Minsheng Bk -H-			HKD	-	637 500	-637 500	-	-	0.00
China Oilfield Services -H-			HKD	200 000	58 000	-258 000	-	-	0.00
China Overseas Land+Investment			HKD	89 600	-	-89 600	-	-	0.00
China Overseas Property Hld Ltd			HKD	220 000	305 000	-105 000	420 000	251 761.91	0.72
China Resources Land			HKD	55 000	8 000	-63 000	-	-	0.00
China Vanke -H-			HKD	160 300	-	-160 300	-	-	0.00
Cholamandalam Investment Fin			INR	-	17 483	-2 254	15 229	259 968.35	0.74
Chongqing Rural Shs-H-			HKD	-	556 000	-50 000	506 000	248 224.23	0.71

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Chunghwa Telecom Co Ltd			TWD	-	55 000	-55 000	-	-	0.00
Cia De Concessoes Rodoviaras			BRL	142 000	69 353	-42 388	168 965	354 086.27	1.01
Cia Energ Minas Gerais /Pref			BRL	88 009	47 934	-26 471	109 472	194 921.03	0.56
Cipla Ltd /Demat.			INR	15 900	5 162	-7 024	14 038	249 283.35	0.71
Citic Securities -H- Shares			HKD	125 500	171 000	-149 500	147 000	216 526.00	0.62
Cn Intl Cap /H			HKD	108 000	-	-108 000	-	-	0.00
Colgate-Palmolive (India) Ltd			INR	10 500	2 203	-5 673	7 030	239 688.24	0.68
Country Garden Holdings			HKD	800 000	358 000	-1 158 000	-	-	0.00
Coway Co Ltd			KRW	3 600	3 463	-1 738	5 325	248 193.99	0.71
Cspc Pharmaceut – Shs			HKD	140 000	328 000	-184 000	284 000	226 257.82	0.64
Ctbc Financial Holding Co Ltd			TWD	200 000	251 000	-233 000	218 000	254 346.32	0.72
Cummins India Ltd			INR	-	10 175	-4 252	5 923	281 759.87	0.80
Dabur India Ltd/Dematerialised			INR	32 400	14 137	-9 013	37 524	270 307.68	0.77
Daqo New Energy/Sadr			USD	3 700	1 200	-4 900	-	-	0.00
Delta Electronic Industrial			TWD	20 000	19 000	-39 000	-	-	0.00
Discovery Shs			ZAR	14 413	-	-14 413	-	-	0.00
Dlf Limited			INR	-	32 061	-11 976	20 085	198 648.72	0.57
Dongbu Insurance Co Ltd			KRW	4 400	412	-4 812	-	-	0.00
Dongfeng Motor -H-			HKD	-	566 000	-566 000	-	-	0.00
Doosan Enerbili Rg Shs			KRW	-	18 706	-18 706	-	-	0.00
E Sun Financial Holding Ltd			TWD	-	320 090	-63 000	257 090	226 253.02	0.64
East Buy Holding Limited 144A			HKD	30 000	42 800	-72 800	-	-	0.00
Eclat Textile Co Ltd			TWD	11 000	5 000	-2 000	14 000	228 289.95	0.65
Engie Brasil Energia Sa			BRL	-	52 694	-26 185	26 509	211 377.32	0.60
Enn Energy Holdings			HKD	-	17 300	-17 300	-	-	0.00
Far East Horizon			HKD	308 000	227 000	-535 000	-	-	0.00
Far Eastone Telecom. Co Ltd			TWD	-	97 000	-97 000	-	-	0.00
First Financial Holding Comp.			TWD	-	235 870	-235 870	-	-	0.00
Firstrand Ltd /New			ZAR	70 000	7 324	-77 324	-	-	0.00
Flat Glass Group Co Ltd			HKD	-	122 000	-14 000	108 000	159 080.33	0.45
Fomento Eco.Mexicano Sab /Units			MXN	23 500	19 167	-42 667	-	-	0.00
Fosun International Ltd			HKD	260 000	-	-260 000	-	-	0.00
Fubon Financial Holding Co Ltd			TWD	100 800	123 040	-120 840	103 000	251 775.52	0.72
Gcl Tech – Registered Shs			HKD	700 000	360 000	-1 060 000	-	-	0.00
Genscript Biotech Corp			HKD	54 000	-	-54 000	-	-	0.00
Giant Manufacture Co Ltd			TWD	27 000	3 000	-30 000	-	-	0.00
Ginlong Techno Rg-A			CNH	-	33 000	-	33 000	189 114.57	0.54
Globalwafers Co Ltd			TWD	-	15 000	-2 000	13 000	215 990.78	0.62
Greentown China Holdings Ltd			HKD	-	204 500	-204 500	-	-	0.00
Grupo Bimbo Sab De Cv -A-			MXN	-	44 582	-44 582	-	-	0.00
Grupo Fin Banorte -O-			MXN	22 000	24 763	-20 655	26 108	203 289.35	0.58
Guodian Nari Technology Co -A-			CNH	28 800	10 000	-38 800	-	-	0.00
Guoyuan Securities Co Ltd			CNH	-	262 400	-23 364	239 036	199 359.18	0.57
Haier Smart Home Co Ltd H			HKD	-	88 400	-20 000	68 400	228 660.68	0.65
Haitan Intl Hldgs Ltd			HKD	-	89 000	-21 000	68 000	193 355.61	0.55
Haitong Sec -H-			HKD	-	336 000	-336 000	-	-	0.00
Hana Financial Group Inc			KRW	-	6 540	-6 540	-	-	0.00
Hanmi Pharm *Opr*			KRW	-	1 203	-153	1 050	206 202.15	0.59
Hanon Systems			KRW	-	62 471	-7 742	54 729	187 938.29	0.54
Hansoh Co Ltd			HKD	-	118 000	-16 000	102 000	213 213.75	0.61
Hanwha Chemical Corp			KRW	19 774	22 836	-14 092	28 518	571 432.28	1.63
Hanwha Galleria Rg			KRW	19 256	-	-19 256	-	-	0.00
Havells India Ltd			INR	10 500	12 675	-23 175	-	-	0.00
Hcl Technologies /Demat.			INR	14 900	15 950	-19 249	11 601	203 058.37	0.58
Hdfc Bank Ltd			INR	-	32 208	-16 090	16 118	325 456.74	0.93
Hindustan Unilever Ltd			INR	7 000	3 593	-2 117	8 476	251 371.17	0.72
Hotai Motor Co Ltd			TWD	-	13 200	-2 000	11 200	214 739.28	0.61
Housing Devt Fin Corp			INR	17 500	-	-17 500	-	-	0.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Hua Nan Financial Holding Co			TWD	258 146	348 000	-304 146	302 000	245 761.56	0.70
Huatai Securities Co Ltd			HKD	182 800	78 800	-66 800	194 800	215 325.09	0.61
Hygeia Healthc Rg			HKD	28 000	62 200	-36 000	54 200	195 421.60	0.56
Hz Tigermed C-H Rg			HKD	30 800	-	-30 800	-	-	0.00
Icici			INR	11 600	1 503	-13 103	-	-	0.00
Impala Platinum Holdings Ltd			ZAR	23 000	-	-23 000	-	-	0.00
Indus Towers Rg Registered Shs			INR	80 600	-	-80 600	-	-	0.00
Info Edge India Ltd			INR	3 000	1 116	-4 116	-	-	0.00
Infosys -- Shs			INR	38 700	12 048	-19 159	31 589	593 508.85	1.69
Innovent Biologics. Inc.			HKD	-	39 500	-39 500	-	-	0.00
Itau Holding /Pref			BRL	-	33 100	-33 100	-	-	0.00
Jd Health Intl			HKD	-	40 300	-40 300	-	-	0.00
Jd.Com Rg-A			HKD	32 600	-	-32 600	-	-	0.00
Jiangsu Expressway Co -H-			HKD	-	226 000	-226 000	-	-	0.00
Jiumaojiu Intl Rg			HKD	-	194 000	-194 000	-	-	0.00
Kanzhun Limited /Sadr			USD	-	16 686	-5 510	11 176	210 220.56	0.60
Kingboard Laminates Hldgs Ltd			HKD	145 000	-	-145 000	-	-	0.00
Kingdee Int Software Gr.Co Ltd			HKD	113 000	167 000	-280 000	-	-	0.00
Klabin Riocell Sa			BRL	70 400	-	-70 400	-	-	0.00
Kotak Mahind			INR	9 400	1 231	-10 631	-	-	0.00
Kuaishou Tech Rg-B			HKD	28 000	-	-28 000	-	-	0.00
Kumba Iron Ore Ltd			ZAR	7 000	4 527	-2 086	9 441	227 304.70	0.65
Largan Precision Co Ltd			TWD	-	4 000	-480	3 520	297 843.48	0.85
Lg Chem Ltd /Pfd Shs /I01			KRW	2 530	1 079	-831	2 778	486 055.55	1.39
Lg Chemical Ltd			KRW	1 250	1 150	-615	1 785	447 736.91	1.28
Lg Electronics Inc			KRW	-	5 751	-2 568	3 183	256 274.15	0.73
Lg Energy Solu Rg			KRW	350	233	-583	-	-	0.00
Lg Household & Healthcare Ltd			KRW	-	826	-826	-	-	0.00
Li Auto Inc - A - Shs			HKD	15 000	23 300	-17 400	20 900	188 189.98	0.54
Lite-On Technology Corpor.			TWD	-	55 000	-55 000	-	-	0.00
Localiza Rent A Car			BRL	30 000	30 334	-16 961	43 373	327 965.46	0.93
Lojas Renner Sa			BRL	50 000	79 257	-129 257	-	-	0.00
Longfor Ppt			HKD	96 000	80 500	-176 500	-	-	0.00
Ltimindtree Limited			INR	3 358	4 143	-3 890	3 611	233 189.42	0.66
Marico Ltd /Demat			INR	-	41 598	-5 245	36 353	267 234.39	0.76
Media Tek Incorporation			TWD	-	19 000	-4 000	15 000	647 325.00	1.84
Mega Financial Holding Company			TWD	-	216 336	-42 000	174 336	217 105.85	0.62
Meituan Dianping			HKD	52 810	-	-52 810	-	-	0.00
Microport Scientific Corp			HKD	93 000	-	-93 000	-	-	0.00
Micro-Star Intl			TWD	-	36 000	-36 000	-	-	0.00
Miniso Grp /Sadr			USD	-	12 104	-1 612	10 492	200 082.44	0.57
Momo.Com Inc			TWD	7 000	5 700	-12 700	-	-	0.00
Mphasis Ltd /Demat.			INR	-	7 033	-7 033	-	-	0.00
Mr. Price Group Limited			ZAR	15 700	-	-15 700	-	-	0.00
Nan Ya Pcb			TWD	24 000	-	-24 000	-	-	0.00
Naspers Ltd -N-			ZAR	1 430	-	-1 430	-	-	0.00
Naspers Rg			ZAR	-	2 137	-538	1 599	312 378.73	0.89
Natura Co Hldg Rg			BRL	-	56 000	-56 000	-	-	0.00
Naura Technology Group Co Ltd			CNH	-	5 300	-472	4 828	212 553.50	0.61
Naver Corp - Shs			KRW	-	1 457	-1 457	-	-	0.00
Ncsoft Corporation			KRW	560	-	-560	-	-	0.00
Nedbank Group			ZAR	18 700	-	-18 700	-	-	0.00
Nepi Rockcast Rg			ZAR	-	35 354	-3 148	32 206	231 705.36	0.66
Nestle India /Dematerialised			INR	1 040	69	-1 109	-	-	0.00
Nestle India Rg			INR	-	9 304	-2 066	7 238	221 478.36	0.63
Netease Rg			HKD	15 000	12 100	-14 500	12 600	240 626.29	0.69
Nien Made Enterprise Co Ltd			TWD	19 000	6 000	-6 000	19 000	228 413.25	0.65
Nio Inc			USD	-	37 430	-37 430	-	-	0.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Old Mutual Limited			ZAR	290 000	421 024	-327 488	383 536	260 243.88	0.74
Persistent Sys Rg			INR	-	4 875	-434	4 441	225 884.66	0.64
Persistent Systems Ltd			INR	-	1 958	-1 958	-	-	0.00
Phar Rg-H 144A-S			HKD	46 200	-	-46 200	-	-	0.00
Ping An Hlthcare Tech Co			HKD	78 300	-	-78 300	-	-	0.00
Ping An Insur.(Grp) Co -H-			HKD	94 700	8 500	-103 200	-	-	0.00
Polycab India Ltd			INR	-	3 916	-559	3 357	271 313.02	0.77
Pop Mart Intl Rg			HKD	-	83 400	-27 200	56 200	275 335.77	0.78
Posco Daewoo Corp			KRW	-	5 900	-5 900	-	-	0.00
Posco Dx Company Ltd			KRW	-	7 837	-941	6 896	191 999.12	0.55
President Chain Store Corp.			TWD	22 000	2 000	-24 000	-	-	0.00
Psbc /H			HKD	-	501 000	-66 000	435 000	255 181.75	0.73
Raia Drogasil			BRL	-	36 326	-36 326	-	-	0.00
Rec Ltd			INR	-	45 584	-4 059	41 525	261 632.28	0.75
Rede Dor Sao Lui Rg			BRL	-	48 405	-4 310	44 095	215 932.30	0.62
Right Localiza Re 06.08.24 /Sous			BRL	-	438	-	438	709.70	0.00
Rights Localiza 10.11.23 Sous			BRL	-	168	-168	-	-	0.00
Sabesp-Rg Shs			BRL	19 000	16 214	-21 830	13 384	180 647.85	0.51
Samsung Electr. /Pfd N-Vot.			KRW	5 100	1 307	-1 493	4 914	226 897.07	0.65
Samsung Electro-Mechanics Co			KRW	-	1 800	-1 800	-	-	0.00
Samsung Electronics Co Ltd			KRW	32 000	7 863	-10 359	29 504	1 745 722.18	4.98
Samsung Fire&Marine Insur.			KRW	1 500	128	-1 628	-	-	0.00
Samsung Life Insurance Co Ltd			KRW	-	4 073	-4 073	-	-	0.00
Samsung Sdi Co Ltd			KRW	-	517	-517	-	-	0.00
Sanlam Ltd			ZAR	-	58 987	-58 987	-	-	0.00
Santander Br /Units (55Sh+50Pfd)			BRL	33 000	22 258	-15 014	40 244	198 957.83	0.57
Sany Heavy Eq			HKD	-	228 000	-228 000	-	-	0.00
Sh C&S Bk			TWD	-	161 000	-161 000	-	-	0.00
Shanghai Rural Rg-A			CNH	-	247 300	-22 020	225 280	208 349.39	0.59
Shinhan Financial Group			KRW	5 000	7 595	-12 595	-	-	0.00
Shriram Finance Limited			INR	11 000	8 915	-12 547	7 368	257 251.57	0.73
Sichuan Chuantou Energy Co Ltd			CNH	-	97 900	-8 717	89 183	230 135.54	0.66
Siemens Ltd /Dematerialised			INR	7 000	565	-4 297	3 268	301 938.25	0.86
Sinopac Holdings			TWD	300 000	387 000	-368 000	319 000	249 762.65	0.71
Sinotruk (Hong Kong) Ltd			HKD	-	113 500	-37 500	76 000	197 608.00	0.56
Sk Biopharmac Rg			KRW	3 630	-	-3 630	-	-	0.00
Sk Hynix Inc			KRW	4 000	662	-1 501	3 161	542 740.54	1.55
Sk Square Rg			KRW	-	6 439	-6 439	-	-	0.00
Sungrow Power Supply Co Ltd			CNH	-	20 440	-	20 440	174 495.01	0.50
Sz Inovance			CNH	-	30 000	-	30 000	211 806.34	0.60
Sz New Ind Rg-A			CNH	-	20 000	-	20 000	185 629.88	0.53
Taiwan Semicond.Manufact			TWD	142 000	36 000	-64 000	114 000	3 394 572.30	9.68
Tata Consultancy Serv/Demat.			INR	10 000	2 806	-3 315	9 491	444 355.02	1.27
Tata Elxsi Ltd			INR	2 500	884	-1 093	2 291	192 354.17	0.55
Telefonica Brasil Sa			BRL	-	23 000	-23 000	-	-	0.00
Tencent Holdings Ltd			HKD	44 400	5 700	-14 700	35 400	1 688 526.25	4.81
Tencent Mus			USD	23 000	23 186	-46 186	-	-	0.00
The Foschini Group			ZAR	45 200	-	-45 200	-	-	0.00
Titan Com Shs			INR	6 500	1 819	-3 410	4 909	200 400.92	0.57
Tongcheng Tra-Rg Shs S /144A			HKD	-	124 800	-47 600	77 200	153 660.84	0.44
Totvs Sa			BRL	32 600	30 000	-62 600	-	-	0.00
Travelsky Technology Ltd -H-			HKD	-	219 000	-30 000	189 000	221 744.14	0.63
Ultrapar Participacoes Sa			BRL	111 600	-	-111 600	-	-	0.00
Unimicron Technology Corp			TWD	37 000	-	-37 000	-	-	0.00
United Microelectronic Corp			TWD	-	135 000	-135 000	-	-	0.00
Vibra Energia S.A.			BRL	-	61 397	-4 576	56 821	213 803.35	0.61
Vipshop Hldg Sp Adrrepr 1/5Th			USD	14 500	1 949	-2 781	13 668	177 957.36	0.51
Vodacom			ZAR	-	36 326	-36 326	-	-	0.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Voltron Pow			TWD	3 000	1 000	-4 000	-	-	0.00
Wal-Mart De Mexico Sab Decv			MXN	55 000	50 495	-105 495	-	-	0.00
Walsin Lihwa Corporation			TWD	112 000	-	-112 000	-	-	0.00
Weg Sa			BRL	46 000	37 157	-23 944	59 213	449 765.30	1.28
Weichai Power Co Ltd /-H-			HKD	112 000	15 000	-127 000	-	-	0.00
Weifu Hi-Tech Group Co Ltd -A-			CNH	20 000	-	-20 000	-	-	0.00
Wipro Ltd /Dematerialised			INR	-	41 755	-41 755	-	-	0.00
Woolworths Hld Ltd			ZAR	-	107 147	-107 147	-	-	0.00
Wuxi Apptec Co.. Ltd.			HKD	20 000	1 500	-21 500	-	-	0.00
Wuxi Biologics Rg			HKD	36 000	3 000	-39 000	-	-	0.00
Xinjiang Goldwind -H-			HKD	286 000	-	-286 000	-	-	0.00
Xinyi Solar Holdings Shs			HKD	-	306 000	-28 000	278 000	139 936.89	0.40
Xpeng Rg-A			HKD	-	46 800	-46 800	-	-	0.00
Xtep International Hldgs Ltd			HKD	-	406 000	-406 000	-	-	0.00
Yadea Group Holdings Ltd			HKD	100 000	46 000	-20 000	126 000	159 287.82	0.45
Yuanta Financial Holding Co			TWD	-	262 000	-34 000	228 000	225 250.61	0.64
Yuexiu Property – Reg Shs			HKD	-	309 000	-309 000	-	-	0.00
Yuhan Corp			KRW	-	6 570	-1 965	4 605	270 467.31	0.77
Yum China Holdings Inc			USD	3 630	3 761	-943	6 448	198 856.32	0.57
Zai Lab Rg			HKD	-	84 000	-84 000	-	-	0.00
Zhejiang Supor Cookware Co -A-			CNH	5 000	25 100	-2 680	27 420	189 062.55	0.54
Zomat Rg 144A Reg S			INR	243 900	-	-243 900	-	-	0.00
							34 259 394.98	97.66	

Anleihen

Wuxi Biologics (Cayman) Inc. Usd 0.0	0.000	31.12.99	HKD	-	61	-61	-	-	0.00
								-	0.00

Optionen auf Wertpapiere

Right Localiza Re 05.02.24 /Sous		02.05.24	BRL	-	169	-169	-	-	0.00
								-	0.00

Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

34 259 394.98 97.66

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Aktien

E Ink Holdings Inc			TWD	30 000	-	-30 000	-	-	0.00
Jyp Entertainment Corp			KRW	-	2 532	-2 532	-	-	0.00
Pharmaessentia 1 Rg			TWD	-	19 000	-19 000	-	-	0.00
Vanguard Intl.Semiconduct			TWD	63 000	-	-63 000	-	-	0.00
								-	0.00

Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere

- **0.00**

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets (Fortsetzung)

		01.07.2023			Schlussbestand 30.06.2024		USD	
Sonstige übertragbare Wertpapiere								
Aktien								
Akeso Rg	HKD	-	45 000	-10 000	35 000		169 230.99	0.48
							169 230.99	0.48
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere							169 230.99	0.48
SUMME WERTPAPIERBESTAND							34 428 625.97	98.14
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen							598 899.37	1.71
Sonstige Aktiven							53 814.27	0.15
GESAMTNETTOVERMÖGEN							35 081 339.61	100.00

JSS Sustainable Equity - Global Dividend

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Aktien									
Allianz Se/Nam.Vinkuliert			EUR	21 927	2 490	-4 223	20 194	5 616 337.61	1.65
Amgen Inc			USD	37 326	13 564	-10 558	40 332	12 601 733.40	3.71
Asr Nederland Nv			EUR	108 434	12 288	-20 951	99 771	4 759 435.13	1.40
Automatic Data Proces.			USD	-	25 523	-	25 523	6 092 084.87	1.79
Axa			EUR	242 617	30 518	-171 932	101 203	3 315 754.12	0.98
Bristol Myers Squibb Co			USD	173 491	20 674	-38 235	155 930	6 475 772.90	1.90
Broadcom Inc			USD	-	8 530	-794	7 736	12 420 380.08	3.65
Caterpillar Inc.			USD	50 072	4 543	-43 822	10 793	3 595 148.30	1.06
Cme Group Inc			USD	67 806	9 609	-30 329	47 086	9 257 107.60	2.72
Darden Restaurants			USD	85 094	16 518	-27 677	73 935	11 187 844.20	3.29
Deutsche Post Ag			EUR	80 674	53 904	-34 548	100 030	4 051 358.29	1.19
Deutsche Telekom /Nam.			EUR	275 240	83 337	-101 092	257 485	6 479 530.20	1.91
Emerson Electric Co.			USD	131 181	29 996	-39 177	122 000	13 439 520.00	3.95
Ferrovial Intl Rg			EUR	163 527	63 391	-62 809	164 109	6 377 547.34	1.88
Gilead Sciences Inc.			USD	76 197	99 813	-41 754	134 256	9 211 304.16	2.71
Home Depot Inc.			USD	40 327	6 722	-9 084	37 965	13 069 071.60	3.84
Ibm			USD	85 954	11 701	-24 367	73 288	12 675 159.60	3.73
Illinois Tool Works			USD	-	52 822	-7 076	45 746	10 839 972.16	3.19
Inditex			EUR	217 964	20 664	-107 426	131 202	6 518 945.87	1.92
Johnson & Johnson			USD	60 530	6 948	-11 597	55 881	8 167 566.96	2.40
Koninklijke Ahold Delhaize N.V.			EUR	151 084	17 551	-29 133	139 502	4 125 015.90	1.21
Kuehne +Nagel International			CHF	17 103	3 953	-5 265	15 791	4 540 834.26	1.34
Mcdonald S Corp.			USD	44 702	3 774	-13 372	35 104	8 945 903.36	2.63
Merck			USD	101 161	13 970	-21 943	93 188	11 536 674.40	3.39
Michelin Sa Shs			EUR	152 417	17 208	-29 278	140 347	5 431 554.16	1.60
Microchip Technology Inc.			USD	-	147 284	-9 728	137 556	12 586 374.00	3.70
Nestle / Act Nom			CHF	41 020	14 581	-7 991	47 610	4 859 546.43	1.43
Novartis Ag Basel/Nam.			CHF	42 217	20 340	-8 909	53 648	5 741 517.07	1.69
Novo Nordisk A/S /-B-			DKK	29 500	1 643	-31 143	-	-	0.00
Novo Nordisk As -B-			DKK	-	49 503	-10 782	38 721	5 595 951.33	1.65
Paccar Inc.			USD	159 318	22 901	-66 295	115 924	11 933 216.56	3.51
Pepsico Inc			USD	62 016	7 253	-12 041	57 228	9 438 614.04	2.78
Pluxee			EUR	-	43 286	-43 286	-	-	0.00
Pnc Financial Services Gp			USD	64 815	3 775	-68 590	-	-	0.00
Procter & Gamble Co.			USD	79 899	15 770	-25 667	70 002	11 544 729.84	3.40
Rockwell Automation			USD	32 558	1 722	-34 280	-	-	0.00
Royal Bank Of Canada			CAD	125 187	22 745	-33 524	114 408	12 177 820.86	3.58
Sandoz Group N			CHF	-	7 992	-7 992	-	-	0.00
Sanofi			EUR	41 957	4 662	-8 115	38 504	3 711 523.58	1.09
Schneider Electric Se			EUR	30 711	3 528	-20 111	14 128	3 396 279.72	1.00
Sgs Sa			CHF	-	29 988	-	29 988	2 669 752.47	0.78
Skf Ab -B-			SEK	-	339 604	-43 372	296 232	5 952 505.24	1.75
Sodexo			EUR	56 939	26 741	-19 578	64 102	5 770 910.75	1.70
Te Connectivity /Reg Shs			USD	42 891	2 457	-45 348	-	-	0.00
Texas Instruments Inc			USD	70 886	14 658	-15 932	69 612	13 541 622.36	3.98
Total Sa			EUR	88 024	9 498	-27 477	70 045	4 679 158.52	1.38
Upm-Kymmene Corp			EUR	115 161	69 974	-24 018	161 117	5 632 728.46	1.66
Utd Parcel Service Inc B			USD	59 083	35 400	-15 359	79 124	10 828 119.40	3.18
Vodafone Group Plc			GBP	3 370 646	150 516	-3 521 162	-	-	0.00
Zurich Insurance Group /Nam			CHF	5 149	5 728	-1 289	9 588	5 111 963.03	1.50
							335 903 890.13	98.80	

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Global Dividend (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Indexoptionen									
Caterpillar Inc.		17.11.23	USD	-	243	-243	-	-	0.00
Caterpillar Inc.		19.04.24	USD	-	223	-223	-	-	0.00
Kuehne +Nagel International		15.03.24	CHF	-	77	-77	-	-	0.00
Schneider Electric Se		15.03.24	EUR	-	139	-139	-	-	0.00
Utd Parcel Service Inc -B-		21.06.24	USD	-	288	-288	-	-	0.00
								-	0.00
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind							335 903 890.13	98.80	
SUMME WERTPAPIERBESTAND							335 903 890.13	98.80	
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen							3 858 871.28	1.13	
Sonstige Aktiven							237 269.50	0.07	
GESAMTNETTOVERMÖGEN							340 000 030.91	100.00	

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
-------------	---	------------------------	---------	------------------------------	--------	-----------	------------------------------	---------------------	------------------------------

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

Aktien

Accenture Plc			USD	-	3 510	-1 445	2 065	584 596.83	0.94
Aia Group Ltd			HKD	95 600	44 200	-139 800	-	-	0.00
Air Liquide			EUR	2 716	2 569	-730	4 555	734 630.40	1.19
Alphabet Inc -A-			USD	11 111	6 590	-6 873	10 828	1 840 280.10	2.97
Amazon Com Inc			USD	10 236	6 849	-5 536	11 549	2 082 429.90	3.36
American Tower Corp			USD	-	3 252	-1 151	2 101	381 051.91	0.61
Amgen Inc			USD	1 987	1 363	-795	2 555	744 865.64	1.20
Apple Inc			USD	-	12 975	-935	12 040	2 366 097.32	3.82
Aramark Holdings Corp			USD	16 658	357	-17 015	-	-	0.00
Asml Holding Nv			EUR	1 021	1 015	-486	1 550	1 494 510.00	2.41
Blackrock Inc			USD	-	898	-	898	659 681.23	1.06
Broadcom Inc			USD	-	1 233	-667	566	847 893.61	1.37
Cme Group Inc			USD	4 466	3 833	-3 650	4 649	852 804.67	1.38
Colgate-Palmolive Co.			USD	6 116	7 910	-4 490	9 536	863 422.85	1.39
Compass Group Plc			GBP	-	36 796	-5 447	31 349	798 666.34	1.29
Costco Wholesale Corp			USD	-	1 143	-550	593	470 300.04	0.76
D S Smith Plc			GBP	59 324	41 176	-100 500	-	-	0.00
Daikin Industries Ltd			JPY	1 300	2 200	-3 500	-	-	0.00
Deere & Co.			USD	1 096	1 691	-431	2 356	821 341.06	1.33
Dsm-Firmenich Ltd			EUR	3 995	2 818	-6 813	-	-	0.00
Ecolab Inc.			USD	3 445	2 740	-3 961	2 224	493 876.37	0.80
Edwards Lifesciences			USD	7 550	4 926	-3 976	8 500	732 582.23	1.18
Equinix Inc /Reit			USD	535	10	-545	-	-	0.00
Equinor Asa			NOK	19 340	29 918	-49 258	-	-	0.00
Essilor International			EUR	1 940	2 210	-526	3 624	729 148.80	1.18
Fortinet			USD	-	8 540	-	8 540	480 248.01	0.77
Home Depot Inc.			USD	-	3 347	-425	2 922	938 529.77	1.51
Housing Devt. Fin. Corp /Adr			USD	5 804	3 928	-9 732	-	-	0.00
Hydro One Ltd			CAD	-	24 200	-3 100	21 100	573 350.23	0.93
Illumina Inc			USD	2 731	57	-2 788	-	-	0.00
Intl Flavors Frag			USD	3 515	74	-3 589	-	-	0.00
Keyence Corp			JPY	-	2 400	-300	2 100	859 359.82	1.39
Lilly (Eli) & Co			USD	-	1 110	-	1 110	937 692.37	1.51
Lse Group			GBP	4 658	99	-4 757	-	-	0.00
Lvmh Act.			EUR	-	1 578	-80	1 498	1 068 972.80	1.73
Mastercard Inc. Shs-A-			USD	1 892	1 265	-1 053	2 104	866 060.78	1.40
Medtronic Holdings Limited			USD	9 538	204	-9 742	-	-	0.00
Mercadolibre Inc			USD	-	194	-	194	297 475.72	0.48
Merck			USD	6 678	4 495	-5 563	5 610	648 022.39	1.05
Microsoft Corp			USD	3 314	3 514	-1 629	5 199	2 168 129.74	3.50
Middleby Corp			USD	2 840	60	-2 900	-	-	0.00
Moody S Corp			USD	-	2 453	-	2 453	963 416.18	1.55
Nvidia Corp.			USD	-	20 677	-107	20 570	2 371 091.95	3.83
Occidental Petroleum Corp			USD	-	15 225	-	15 225	895 387.68	1.45
Otis Worldwide Corporation			USD	5 969	7 861	-1 640	12 190	1 094 853.65	1.77
Palo Alto Networks Inc			USD	2 136	44	-2 180	-	-	0.00
Partners Group Holding			CHF	-	537	-	537	643 457.86	1.04
Prologis Inc			USD	-	7 023	-3 197	3 826	400 931.24	0.65
Reckitt Benckiser Group Plc			GBP	9 684	6 455	-16 139	-	-	0.00
Samsonite International			HKD	206 700	3 900	-210 600	-	-	0.00
Service Corp International			USD	6 905	8 099	-15 004	-	-	0.00
Servicenow Inc			USD	1 058	647	-639	1 066	782 449.47	1.26
Shiseido Co.Ltd			JPY	15 000	300	-15 300	-	-	0.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Siemens Ag /Nam.			EUR	2 280	3 443	-678	5 045	876 417.40	1.41
Siemens Healthineers Ag			EUR	-	26 836	-15 012	11 824	636 131.20	1.03
Taiwan Semiconduct. Manuf/Sadr			USD	9 394	6 397	-10 603	5 188	841 358.79	1.36
Takeda Pharmaceutical Co Ltd			JPY	-	35 700	-3 000	32 700	791 317.53	1.28
Tencent Holdings Ltd			HKD	14 800	9 800	-24 600	-	-	0.00
Tetra Tech Inc.			USD	2 076	2 050	-561	3 565	680 169.07	1.10
Texas Instruments Inc			USD	-	2 070	-2 070	-	-	0.00
Unilever Plc			EUR	4 851	3 081	-7 932	-	-	0.00
Walt Disney /Disney Ser			USD	3 967	2 168	-1 670	4 465	413 650.43	0.67
Zoetis Inc -A-			USD	-	8 116	-	8 116	1 312 796.60	2.12
								39 039 449.98	63.03

Anleihen

Aib Grp 2.875% 20-30.05.31	2.875	30.05.31	EUR	-	540 000	-	540 000	523 898.55	0.85
Allianz 2.625% 20-Perp	2.625	31.12.99	EUR	600 000	-	-	600 000	467 778.24	0.75
Alpha Train	2.064	30.06.25	EUR	250 000	100 000	-	350 000	340 130.61	0.55
Amer Movil 2.125% 16-10.03.28	2.125	10.03.28	EUR	200 000	570 000	-	770 000	733 396.13	1.18
Ascendas Re 0.75% 21-23.06.28	0.750	23.06.28	EUR	390 000	140 000	-390 000	140 000	122 574.20	0.20
Austria 2.1% 17-20.09.2117	2.100	20.09.17	EUR	100 000	300 000	-	400 000	291 134.04	0.47
Bco Sab 0.875% 19-22.07.25	0.875	22.07.25	EUR	-	100 000	-	100 000	97 073.88	0.16
Bng 0.625% 17-19.06.27 Regs	0.625	19.06.27	EUR	300 000	-	-	300 000	280 307.55	0.45
Bnp Par 1.125% 20-15.01.32 Regs	1.125	15.01.32	EUR	500 000	500 000	-	1 000 000	920 788.00	1.49
Btps 1.65% 15-01.03.32 /Btp	1.650	01.03.32	EUR	530 000	250 000	-420 000	360 000	309 931.20	0.50
Chile 0.83% 19-02.07.31	0.830	02.07.31	EUR	265 000	-	-265 000	-	-	0.00
Comcast 0.75% 20-20.02.32	0.750	20.02.32	EUR	200 000	-	-	200 000	163 405.38	0.26
Deutschland 1.80% 22-15.08.53	1.800	15.08.53	EUR	-	750 000	-	750 000	619 345.50	1.00
Digital Dut 1.0% 20-15.01.32	1.000	15.01.32	EUR	113 000	820 000	-	933 000	747 561.59	1.21
Eib	3.500	15.04.27	EUR	490 000	-	-40 000	450 000	456 836.85	0.74
Eu 0.0% 20-04.07.35	0.000	04.07.35	EUR	320 000	-	-320 000	-	-	0.00
Fer D Stato 1.5% 17-27.06.25	1.500	27.06.25	EUR	150 000	-	-	150 000	146 988.98	0.24
Fidelity NI 1% 19-03.12.28	1.000	03.12.28	EUR	400 000	100 000	-	500 000	446 552.50	0.72
Fluxys	2.750	27.11.29	EUR	300 000	100 000	-	400 000	367 683.54	0.59
France 2.25% 13-25.05.24 /Oat	2.250	25.05.24	EUR	820 000	160 000	-980 000	-	-	0.00
France 4% 04-25.04.55 Oat	4.000	25.04.55	EUR	350 000	2 125 000	-875 000	1 600 000	1 682 570.72	2.72
France 4.75% 04-25.04.35 Oat	4.750	25.04.35	EUR	575 000	110 000	-685 000	-	-	0.00
Germany	4.750	04.07.28	EUR	880 000	690 000	-1 570 000	-	-	0.00
Germany	5.500	04.01.31	EUR	680 000	630 000	-1 310 000	-	-	0.00
Germany	4.750	04.07.34	EUR	1 150 000	-	-650 000	500 000	598 803.00	0.97
Germany 2% 13-15.08.23	2.000	15.08.23	EUR	933 447	-	-933 447	-	-	0.00
Germany 4.25% 07-04.07.39	4.250	04.07.39	EUR	1 550 000	2 226 000	-2 271 000	1 505 000	1 795 662.46	2.90
Gldm Sachs G 3.375% 27.03.25	3.375	27.03.25	EUR	550 000	-	-	550 000	548 516.65	0.89
Iberdrola 1.825% 21-Perp	1.825	31.12.99	EUR	-	500 000	-	500 000	434 520.00	0.70
Ihg Finance 4.375% 23-28.11.29	4.375	28.11.29	EUR	-	100 000	-	100 000	102 462.45	0.16
Ireland 2.4% 14-15.05.30	2.400	15.05.30	EUR	430 000	260 000	-690 000	-	-	0.00
Italy 4.15% 23-01.10.39 /Btp 144A	4.150	01.10.39	EUR	-	820 000	-	820 000	800 999.58	1.29
Italy 5.25% 98-29 Btp	5.250	01.11.29	EUR	500 000	100 000	-600 000	-	-	0.00
Kkr Group Fin 1.625% 22.05.29	1.625	22.05.29	EUR	-	200 000	-	200 000	180 767.85	0.29
Lloyds Bank 2.375% 20-09.04.26	2.375	09.04.26	EUR	217 000	-	-	217 000	212 701.01	0.34
Lse 0.875% 17-19.09.24	0.875	19.09.24	EUR	300 000	-	-	300 000	298 050.00	0.48
Merck	1.875	15.10.26	EUR	250 000	-	-	250 000	241 600.25	0.39
Mexico Cete 1.125% 20-17.01.30	1.125	17.01.30	EUR	165 000	100 000	-265 000	-	-	0.00
Morgan Stan 4.813% 22-25.10.28	4.813	25.10.28	EUR	-	900 000	-900 000	-	-	0.00
Netherlands	4.000	15.01.37	EUR	480 000	590 000	-1 070 000	-	-	0.00
Orange 1.625% 20-07.04.32	1.625	07.04.32	EUR	100 000	-	-	100 000	87 763.59	0.14
Orange 1.75% 20-Perp	1.750	31.12.99	EUR	200 000	-	-	200 000	178 577.40	0.29
Phoenix Gr 4.375% 18-24.01.29	4.375	24.01.29	EUR	350 000	-	-	350 000	342 921.25	0.55
Portugal 4.1% 15-15.02.45	4.100	15.02.45	EUR	230 000	50 000	-280 000	-	-	0.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Rabobk Ny 0.875% 20-05.05.28	0.875	05.05.28	EUR	400 000	-	-	400 000	371 121.80	0.60
Rbs Group 0.75% 19-15.11.25	0.750	15.11.25	EUR	-	100 000	-100 000	-	-	0.00
Rff 1.125% 15-25.05.30	1.125	25.05.30	EUR	-	300 000	-	300 000	264 872.03	0.43
Rff 4.5% 09-30.01.24	4.500	30.01.24	EUR	150 000	-	-150 000	-	-	0.00
Rff 5% 03-10.10.33	5.000	10.10.33	EUR	300 000	-	-	300 000	333 415.71	0.54
Rte 2% 16-18.04.36	2.000	18.04.36	EUR	-	100 000	-	100 000	84 179.88	0.14
Selp Financ 0.875% 21-27.05.29	0.875	27.05.29	EUR	700 000	-	-	700 000	601 785.80	0.97
Spain 1.5% 17-30.04.27	1.500	30.04.27	EUR	600 000	550 000	-1 150 000	-	-	0.00
Spain 5.9% 11-30.07.26	5.900	30.07.26	EUR	970 000	-	-970 000	-	-	0.00
Spanish 3.25% 24-30.04.34 144A	3.250	30.04.34	EUR	-	2 188 000	-801 000	1 387 000	1 373 535.82	2.22
Spbk Bolikr 0.5% 18-30.01.25	0.500	30.01.25	EUR	450 000	-	-	450 000	442 287.56	0.71
Sr-Bolig 0.01% 20-25.02.30	0.010	25.02.30	EUR	292 000	-	-	292 000	245 173.42	0.40
Sse 1.75% 20-16.04.30	1.750	16.04.30	EUR	500 000	210 000	-710 000	-	-	0.00
Sse 3.125% 20-Perp	3.125	31.12.99	EUR	200 000	313 000	-	513 000	492 946.83	0.80
Standard Frn 20-09.09.30	2.500	09.09.30	EUR	152 000	-	-	152 000	149 091.90	0.24
Tennet 2% 18-05.06.34	2.000	05.06.34	EUR	300 000	-	-	300 000	263 065.23	0.42
Thermo Fish 1.75% 20-15.04.27	1.750	15.04.27	EUR	302 000	-	-	302 000	289 146.43	0.47
Verbund 0.90% 21-01.04.41	0.900	01.04.41	EUR	300 000	-	-	300 000	195 369.38	0.32
Verizon Com 1.85% 20-18.05.40	1.850	18.05.40	EUR	730 000	990 000	-770 000	950 000	723 550.69	1.17
Virgin Mney 2.875% 20-24.06.25	2.875	24.06.25	EUR	420 000	200 000	-620 000	-	-	0.00
York Build 0.625% 20-21.09.25	0.625	21.09.25	EUR	125 000	-	-	125 000	120 538.16	0.19
								20 491 383.59	33.09

Warrants

Wt Carbon Perp Cert		31.12.99	GBP	9 345	5 173	-14 518	-	-	0.00
								-	0.00

Indexoptionen

Euro Stoxx 50 Pr		15.09.23	EUR	17	-	-17	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices		15.09.23	EUR	-17	17	-	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices		15.12.23	USD	-6	6	-	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices		15.09.23	USD	2	-	-2	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices		15.09.23	USD	-2	2	-	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices		15.09.23	USD	-	2	-2	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices		15.12.23	USD	6	-	-6	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices		15.09.23	USD	-	2	-2	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices		15.03.24	USD	-	7	-7	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices		15.03.24	USD	-	7	-7	-	-	0.00
								-	0.00

Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind **59 530 833.57** **96.12**

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Anleihen

Spain 3.45% 16-30.07.66	3.450	30.07.66	EUR	330 000	1 800 000	-1 010 000	1 120 000	994 161.28	1.60
								994 161.28	1.60

Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere **994 161.28** **1.60**

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) (Fortsetzung)

		01.07.2023		Schlussbestand 30.06.2024		EUR	
Sonstige übertragbare Wertpapiere							
Anlagefonds							
Quaer C Argon -B- Eur/Cap	EUR	2 303	1 420	-3 723	-	-	0.00
						-	0.00
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere						-	0.00
SUMME WERTPAPIERBESTAND						60 524 994.85	97.72
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen						1 238 283.11	2.00
Sonstige Aktiven						172 132.09	0.28
GESAMTNETTOVERMÖGEN						61 935 410.05	100.00

JSS Twelve Sustainable Insurance Bond

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Anleihen									
Achmea Bv 2.50% 19-24.09.39	2.500	24.09.39	EUR	6 000 000	-	-	6 000 000	5 326 380.00	1.11
Achmea Bv 4.25% 15-Perp	4.250	31.12.99	EUR	5 034 000	-	-5 034 000	-	-	0.00
Achmea Bv 4.625% 19-Perp Regs	4.625	31.12.99	EUR	3 781 000	-	-	3 781 000	3 421 778.53	0.72
Achmea Bv 5.625% 24-02.11.44	5.625	02.11.44	EUR	-	4 800 000	-	4 800 000	4 827 554.40	1.01
Achmea Bv 6.75% 23-26.12.43	6.750	26.12.43	EUR	1 550 000	3 000 000	-	4 550 000	4 990 106.49	1.04
Admiral Gro 8.5% 06.01.34 Regs	8.500	06.01.34	GBP	-	2 100 000	-	2 100 000	2 747 728.05	0.57
Aegon 5.185% 96-..	1.425	31.12.99	NLG	15 980 000	15 980 000	-15 980 000	15 980 000	5 253 644.99	1.10
Aegon Nv 1.506%-.. /Stp-Dwn	1.506	31.12.99	NLG	11 460 000	-	-	11 460 000	4 356 049.12	0.91
Aegon Nv 4.26%	0.496	31.12.99	NLG	7 500 000	-	-	7 500 000	2 399 362.89	0.50
Ag Insur 3.5% 15-30.06.47	3.500	30.06.47	EUR	8 500 000	100 000	-	8 600 000	8 406 205.88	1.76
Ageas 3.25% 19-02.07.49	3.250	02.07.49	EUR	-	5 000 000	-	5 000 000	4 710 414.75	0.99
Ageas Fin 1.875% 20-24.11.51	1.875	24.11.51	EUR	1 000 000	3 000 000	-	4 000 000	3 304 697.64	0.69
Allianz 2.625% 20-Perp	2.625	31.12.99	EUR	-	2 400 000	-	2 400 000	1 871 112.96	0.39
Allianz 4.252% 22-05.07.52	4.252	05.07.52	EUR	1 000 000	3 000 000	-	4 000 000	3 958 672.00	0.83
Allianz 4.597% 22-07.09.38	4.597	07.09.38	EUR	-	5 000 000	-1 000 000	4 000 000	4 053 950.00	0.85
Allianz 4.851% 24-26.07.54	4.851	26.07.54	EUR	-	3 800 000	-	3 800 000	3 909 864.46	0.82
Allianz Se	3.375	31.12.99	EUR	4 200 000	-	-4 200 000	-	-	0.00
Argentum (Frn) 4.375%	4.375	31.12.99	EUR	5 000 000	3 000 000	-	8 000 000	7 971 570.00	1.67
Argentum 3.5% 16-1.10.46	3.500	01.10.46	EUR	4 000 000	-	-	4 000 000	3 951 073.00	0.83
Asr	5.125	29.09.45	EUR	9 440 000	-	-9 440 000	-	-	0.00
Asr 3.375% 19-02.05.49	3.375	02.05.49	EUR	-	3 600 000	-	3 600 000	3 388 487.40	0.71
Asr 6.625% 24-Perp	6.625	31.12.99	EUR	-	1 800 000	-	1 800 000	1 771 920.00	0.37
Asr 7.0% 22-07.12.43	7.000	07.12.43	EUR	7 900 000	100 000	-	8 000 000	9 053 400.00	1.89
Assgen	5.500	27.10.47	EUR	4 050 000	150 000	-2 200 000	2 000 000	2 068 507.40	0.43
Assgen 5.399% 23-20.04.33	5.399	20.04.33	EUR	1 300 000	200 000	-	1 500 000	1 584 020.55	0.33
Assicuraz Gen.06.269% 06-..Perp	6.269	31.12.99	GBP	2 550 000	-	-	2 550 000	3 030 847.74	0.63
Athora Hold 5.875% 24-10.09.34	5.875	10.09.34	EUR	-	5 750 000	-	5 750 000	5 660 626.31	1.18
Athora Hold 6.625% 23-16.06.28	6.625	16.06.28	EUR	4 200 000	2 150 000	-	6 350 000	6 714 188.38	1.40
Athora Neth 5.375% 22-31.08.32	5.375	31.08.32	EUR	7 000 000	4 100 000	-	11 100 000	10 993 107.00	2.30
Atradius Cr 5% 24-17.04.34	5.000	17.04.34	EUR	-	5 600 000	-	5 600 000	5 600 608.72	1.17
Atradius Fi 5.25% 14-23.09.44	5.250	23.09.44	EUR	2 277 000	100 000	-2 377 000	-	-	0.00
Aviva 3.375% 15-04.12.45	3.375	04.12.45	EUR	3 000 000	-	-	3 000 000	2 960 745.00	0.62
Aviva 3.875% 14-03.07.44	3.875	03.07.44	EUR	-	3 000 000	-	3 000 000	3 000 438.00	0.63
Aviva 6.875% (Frn) 23-27.11.53	6.875	27.11.53	GBP	-	3 900 000	-	3 900 000	4 758 616.79	1.00
Aviva 6.875% 22-Perp	6.875	31.12.99	GBP	1 300 000	-	-	1 300 000	1 457 764.43	0.30
Axa 3.25% 18-28.05.49	3.250	28.05.49	EUR	-	5 000 000	-1 000 000	4 000 000	3 815 923.00	0.80
Axa 3.875% 14-Perp	3.875	31.12.99	EUR	10 000 000	-	-	10 000 000	9 866 280.00	2.06
Axa 3.941% (Frn) 14-Perp	3.941	31.12.99	EUR	4 600 000	-	-	4 600 000	4 579 777.25	0.96
Axa 5.453% (Frn) 14-Perp	5.453	31.12.99	GBP	9 500 000	-	-9 500 000	-	-	0.00
Axa 6.6862% 06-Perp	6.686	31.12.99	GBP	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Axa Frn 03-Perp Emtn	3.106	31.12.99	EUR	2 033 000	-	-	2 033 000	1 872 396.80	0.39
Axa Sa 6.375%(Frn) 24-Perp Regs	6.375	31.12.99	EUR	-	2 650 000	-	2 650 000	2 715 281.43	0.57
Cattol Ass 4.25% 17-14.12.47	4.250	14.12.47	EUR	8 400 000	300 000	-	8 700 000	8 655 245.03	1.81
Chesnara PI 4.75% 22-04.08.32	4.750	04.08.32	GBP	5 800 000	-	-	5 800 000	5 624 224.69	1.18
Cloverie 5.625% 16-24.06.46	5.625	24.06.46	USD	4 000 000	-	-4 000 000	-	-	0.00
Cnp Assuran 1.875% 21-12.10.53	1.875	12.10.53	EUR	-	900 000	-	900 000	711 054.90	0.15
Cnp Assurances	3.100	31.12.99	EUR	5 921 000	-	-	5 921 000	5 325 131.28	1.11
Coface 5.75% 23-28.11.33	5.750	28.11.33	EUR	-	4 900 000	-	4 900 000	5 214 833.33	1.09
Crdt Agr As	4.750	27.09.48	EUR	8 700 000	-	-8 700 000	-	-	0.00
Crdt Agr As 4.25% 15-Perp	4.250	31.12.99	EUR	4 000 000	-	-4 000 000	-	-	0.00
Crdt Agr As 4.5% 14-Perp	4.500	31.12.99	EUR	3 800 000	-	-3 800 000	-	-	0.00
Direct Line 4.0% 20-05.06.32	4.000	05.06.32	GBP	4 760 000	-	-	4 760 000	4 667 151.39	0.98
Direct Line 4.75% 17-Perp Regs	4.750	31.12.99	GBP	5 990 000	280 000	-1 200 000	5 070 000	5 053 038.50	1.06

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Twelve Sustainable Insurance Bond (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Elm Bv 2.6% 15-Perp Regs	2.600	31.12.99	EUR	-	8 950 000	-	8 950 000	8 711 874.96	1.82
Elm Bv 4.5% 16-Perp	4.500	31.12.99	EUR	-	4 000 000	-	4 000 000	4 005 110.00	0.84
Esure	6.750	19.12.24	GBP	340 000	-	-340 000	-	-	0.00
Ethias Sa 6.75% 05.05.33 Regs	6.750	05.05.33	EUR	7 000 000	100 000	-1 500 000	5 600 000	6 131 857.20	1.28
Fidelidade 4.25% 21-04.09.31	4.250	04.09.31	EUR	7 500 000	300 000	-	7 800 000	7 550 712.00	1.58
Fondiaría	5.750	31.12.99	EUR	16 152 000	200 000	-16 352 000	-	-	0.00
Fondiaría 3.875% 18-01.03.28	3.875	01.03.28	EUR	3 950 000	-	-3 950 000	-	-	0.00
Groupama 6.375% (Frn) 14-Perp	6.375	31.12.99	EUR	-	2 200 000	-2 200 000	-	-	0.00
Hanno Rueck 5.875% 22-26.08.43	5.875	26.08.43	EUR	9 000 000	2 100 000	-3 000 000	8 100 000	9 005 478.75	1.88
Hiscox Ltd	6.125	24.11.45	GBP	6 397 000	2 000 000	-2 500 000	5 897 000	6 910 697.89	1.45
Just Grp 5% (Frn) 21-Perp Regs	5.000	31.12.99	GBP	5 000 000	500 000	-	5 500 000	4 901 069.33	1.02
Just Grp 8.125% 19-26.10.29	8.125	26.10.29	GBP	3 700 000	-	-	3 700 000	4 618 667.74	0.97
L&G Grp 5.25% (Frn) 17-21.03.47	5.250	21.03.47	USD	4 831 000	-	-	4 831 000	4 380 072.86	0.92
L&G Grp Plc 5.125% 18-14.11.48	5.125	14.11.48	GBP	3 500 000	-	-	3 500 000	4 019 585.78	0.84
L&G Grp Plc 5.375% 15-27.10.45	5.375	27.10.45	GBP	2 500 000	100 000	-	2 600 000	3 037 856.69	0.64
La Mondiale	5.050	31.12.99	EUR	10 080 000	-	-4 000 000	6 080 000	6 078 297.60	1.27
La Mondiale 4.375% 19-Perp	4.375	31.12.99	EUR	-	2 500 000	-2 500 000	-	-	0.00
La Mondiale 5.875% 17-26.01.47	5.875	26.01.47	USD	-	3 000 000	-	3 000 000	2 733 547.94	0.57
Mapfre 4.375% (Frn) 17-31.03.47	4.375	31.03.47	EUR	5 500 000	300 000	-1 500 000	4 300 000	4 289 862.75	0.90
Munich Re 1.25% 20-26.05.41	1.250	26.05.41	EUR	1 500 000	-	-	1 500 000	1 254 782.33	0.26
Munich Re 3.25% 18-26.05.49	3.250	26.05.49	EUR	4 800 000	-	-	4 800 000	4 631 618.88	0.97
Munich Re 4.25% 24-26.05.44	4.250	26.05.44	EUR	-	3 900 000	-	3 900 000	3 843 746.40	0.80
Mutuelle As 2.125% 21-21.06.52	2.125	21.06.52	EUR	-	2 500 000	-	2 500 000	1 984 384.38	0.42
Nn Group	4.500	31.12.99	EUR	9 600 000	-	-5 000 000	4 600 000	4 599 310.00	0.96
Nn Group 4.625% 17-13.01.48	4.625	13.01.48	EUR	8 482 000	100 000	-	8 582 000	8 673 781.92	1.81
Nn Group 6.0% 23-03.11.43 Regs	6.000	03.11.43	EUR	-	1 280 000	-	1 280 000	1 383 897.60	0.29
Nn Group 6.375% 24-Perp	6.375	31.12.99	EUR	-	2 250 000	-	2 250 000	2 257 385.63	0.47
Pension Ins	8.000	23.11.26	GBP	6 711 000	-	-6 711 000	-	-	0.00
Pension Ins 7.375% 19-Perp	7.375	31.12.99	GBP	1 000 000	-	-	1 000 000	1 144 405.62	0.24
Pension Ins 8% 23-13.11.33	8.000	13.11.33	GBP	-	3 350 000	-	3 350 000	4 227 400.33	0.88
Phoenix Gr 4.375% 18-24.01.29	4.375	24.01.29	EUR	9 737 000	200 000	-	9 937 000	9 736 024.18	2.04
Phoenix Gr 5.75% 18-Perp	5.750	31.12.99	GBP	2 000 000	200 000	-2 200 000	-	-	0.00
Phoenix Gr 7.75% 23-06.12.53	7.750	06.12.53	GBP	-	4 000 000	-	4 000 000	4 915 196.82	1.03
Qbe Ins 2.50% 13.09.38 Regs	2.500	13.09.38	GBP	7 450 000	-	-	7 450 000	7 588 430.70	1.59
Qbe Ins 5.875% 16-17.06.46	5.875	17.06.46	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Quilter 8.625% 23-18.04.33	8.625	18.04.33	GBP	2 600 000	5 000 000	-	7 600 000	9 423 420.54	1.97
Rothesay 7.019% 10.12.34 Regs	7.019	10.12.34	GBP	-	3 050 000	-	3 050 000	3 595 648.28	0.75
Rothesay Li	8.000	30.10.25	GBP	7 420 000	200 000	-	7 620 000	9 163 146.37	1.92
Rothesay Li 3.375% 19-12.07.26 Regs	3.375	12.07.26	GBP	6 760 000	-	-	6 760 000	7 625 447.72	1.59
Rothesay Li 5.5% 19-17.09.29 Regs	5.500	17.09.29	GBP	5 000 000	-	-	5 000 000	5 884 863.19	1.23
Rothesay Li 6.875% 18-Perp	6.875	31.12.99	GBP	2 848 000	-	-	2 848 000	3 175 931.19	0.66
Sanpaolo Vi 4.75% /Frn 14-Perp	4.750	31.12.99	EUR	11 300 000	2 200 000	-11 000 000	2 500 000	2 492 737.50	0.52
Scor Se	3.000	08.06.46	EUR	4 900 000	-	-4 900 000	-	-	0.00
Scor Se 3.25% 15-05.06.47	3.250	05.06.47	EUR	-	4 000 000	-	4 000 000	3 857 150.00	0.81
Scor Se 3.875% 14-Perp	3.875	31.12.99	EUR	3 700 000	200 000	-	3 900 000	3 837 044.25	0.80
Scor Se 5.25% 18-Perp	5.250	31.12.99	USD	2 200 000	-	-2 200 000	-	-	0.00
Sogecap Sa 4.125%/Frn 14-Perp	4.125	31.12.99	EUR	6 800 000	100 000	-	6 900 000	6 805 417.22	1.42
Sogecap Sa 6.5% 23-16.05.44	6.500	16.05.44	EUR	-	7 200 000	-	7 200 000	7 701 732.00	1.61
Talanx 1.75% 21-01.12.42	1.750	01.12.42	EUR	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Unipolsai 4.9% 24-23.05.34	4.900	23.05.34	EUR	-	7 500 000	-	7 500 000	7 397 746.88	1.55
Unipolsai 6.375% 20-Perp	6.375	31.12.99	EUR	6 900 000	-	-2 000 000	4 900 000	4 919 502.00	1.03
Uniq 2.375% 21-09.12.41	2.375	09.12.41	EUR	6 000 000	10 900 000	-	16 900 000	14 312 724.08	2.99
Uniq 3.25% 20-09.10.35	3.250	09.10.35	EUR	6 400 000	4 000 000	-5 000 000	5 400 000	5 317 321.95	1.11
Uniq 6% 15-27.07.46	6.000	27.07.46	EUR	-	1 500 000	-	1 500 000	1 544 056.50	0.32

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Twelve Sustainable Insurance Bond (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Utmost Grp 4.0% 21-15.12.31	4.000	15.12.31	GBP	6 800 000	-	-	6 800 000	6 465 274.75	1.35
Utmost Grp 6.125% 22-Perp	6.125	31.12.99	GBP	8 056 000	250 000	-	8 306 000	8 255 251.56	1.73
							439 993 252.74		92.01
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind								439 993 252.74	92.01
Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden									
Anleihen									
Assgen 5.272% 23-12.09.33	5.272	12.09.33	EUR	-	4 000 000	-	4 000 000	4 200 306.00	0.88
Axa 4.25% 22-10.03.43	4.250	10.03.43	EUR	-	2 500 000	-	2 500 000	2 437 658.75	0.51
Beazley Re 5.50% 19-10.09.29	5.500	10.09.29	USD	5 150 000	-	-5 150 000	-	-	0.00
Just Grp 7.0% 20-15.04.31	7.000	15.04.31	GBP	5 950 000	100 000	-	6 050 000	7 238 913.78	1.52
RI Fin 6 10.125% 23-Perp	10.125	31.12.99	GBP	3 500 000	-	-	3 500 000	4 504 240.12	0.94
							18 381 118.65		3.85
Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere								18 381 118.65	3.85
SUMME WERTPAPIERBESTAND								458 374 371.39	95.86
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								8 564 801.63	1.79
Sonstige Aktiven								11 252 910.06	2.35
GESAMTNETTOVERMÖGEN								478 192 083.08	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Global Thematic

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Aktien									
Taiwan Semiconduct.Manuf/Sadr			USD	228 881	-	-	228 881	37 118 550.60	4.26
Activision Blizzard Inc			USD	397 579	-	-397 579	-	-	0.00
Aia Group Ltd			HKD	3 547 800	-	-3 547 800	-	-	0.00
Airbnb Rg-A			USD	-	84 799	-	84 799	11 997 268.36	1.38
Alibaba Group Holding Ltd			HKD	1 980 400	-	-1 980 400	-	-	0.00
Alphabet Inc -A-			USD	384 164	-	-81 949	302 215	51 363 155.82	5.89
Alstom			EUR	534 346	-	-534 346	-	-	0.00
Amazon Com Inc			USD	392 476	16 443	-97 568	311 351	56 140 499.88	6.44
Aramark Holdings Corp			USD	481 409	183 994	-665 403	-	-	0.00
Asml Holding Nv			EUR	30 002	-	-	30 002	28 927 928.40	3.32
Booking Holdings Inc			USD	6 998	-	-6 998	-	-	0.00
Cme Group Inc			USD	129 997	37 638	-	167 635	30 750 679.73	3.53
Compass Group Plc			GBP	-	1 003 396	-	1 003 396	25 563 131.59	2.93
Daikin Industries Ltd			JPY	57 505	31 400	-88 905	-	-	0.00
Dassault Systemes			EUR	-	381 224	-	381 224	13 457 207.20	1.54
Deere & Co.			USD	37 231	9 624	-9 938	36 917	12 869 884.50	1.48
Dsm-Firmenich Ltd			EUR	119 370	72 290	-	191 660	20 239 296.00	2.32
Ecolab Inc.			USD	198 809	-	-112 599	86 210	19 144 371.36	2.20
Edwards Lifesciences			USD	176 118	-	-	176 118	15 178 931.34	1.74
Entegris Inc			USD	147 962	92 656	-42 800	197 818	24 991 422.63	2.87
Equinor Sa			NOK	696 177	147 984	-	844 161	22 484 715.63	2.58
Essilor International			EUR	73 036	24 705	-14 077	83 664	16 833 196.80	1.93
Facebook Inc -A-			USD	151 549	4 495	-111 199	44 845	21 097 966.78	2.42
Fomento Economico Mexicano / Adr			USD	195 711	-	-152 466	43 245	4 343 666.20	0.50
Fortinet			USD	-	230 003	-	230 003	12 934 248.48	1.48
Home Depot Inc.			USD	-	64 879	-	64 879	20 838 765.53	2.39
Illumina Inc			USD	96 292	-	-96 292	-	-	0.00
Intl Flavors Frag			USD	215 627	-	-215 627	-	-	0.00
Keyence Corp			JPY	37 100	6 500	-	43 600	17 841 946.82	2.05
Lilly (Eli) & Co			USD	-	21 503	-	21 503	18 165 044.22	2.08
Lse Group			GBP	326 132	-	-72 078	254 054	28 167 080.17	3.23
Medtronic Holdings Limited			USD	336 028	-	-134 590	201 438	14 793 734.53	1.70
Mercadolibre Inc			USD	-	13 151	-	13 151	20 165 480.20	2.31
Merck			USD	196 316	-	-44 907	151 409	17 489 558.39	2.01
Microsoft Corp			USD	122 199	-	-	122 199	50 960 432.05	5.85
Middleby Corp			USD	114 388	48 128	-	162 516	18 592 103.35	2.13
Nvidia Corp.			USD	-	283 300	-	283 300	32 655 826.45	3.75
Otis Worldwide Corporation			USD	182 753	129 932	-	312 685	28 084 029.02	3.22
Prudential Plc			GBP	1 345 036	765 594	-	2 110 630	17 884 070.35	2.05
Reckitt Benckiser Group Plc			GBP	530 920	-	-530 920	-	-	0.00
Servicenow Inc			USD	38 568	-	-35 239	3 329	2 443 503.08	0.28
Shiseido Co.Ltd			JPY	523 296	-	-523 296	-	-	0.00
Siemens Ag /Nam.			EUR	108 004	-	-	108 004	18 762 454.88	2.15
Siemens Healthineers Ag			EUR	-	312 000	-	312 000	16 785 600.00	1.93
Smith And Nephew Plc			GBP	1 718 572	-	-1 718 572	-	-	0.00
Splunk Inc			USD	213 264	-	-213 264	-	-	0.00
Te Connectivity /Reg Shs			USD	-	76 196	-	76 196	10 694 811.55	1.23
Teleflex Inc			USD	120 809	-	-120 809	-	-	0.00
Tencent Holdings Ltd			HKD	-	543 200	-493 300	49 900	2 220 811.04	0.26
Tetra Tech Inc.			USD	134 764	-	-34 830	99 934	19 066 484.09	2.19
Thermo Fisher Scientific Inc			USD	-	44 290	-	44 290	22 852 689.53	2.62
Under Armour Inc /-A-			USD	2 451 302	-	-2 451 302	-	-	0.00
Unilever Plc			EUR	315 368	-	-	315 368	16 172 071.04	1.86

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Global Thematic (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Vestis Corporation			USD	-	240 704	-240 704	-	-	0.00
Walt Disney /Disney Ser			USD	312 059	-	-115 300	196 759	18 228 319.21	2.09
Zoetis Inc -A-			USD	109 303	63 626	-	172 929	27 971 981.75	3.21
							866 272 918.55		99.40
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind								866 272 918.55	99.40
SUMME WERTPAPIERBESTAND								866 272 918.55	99.40
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								7 283 804.28	0.84
Sonstige Passiven								-2 080 437.06	-0.24
GESAMTNETTOVERMÖGEN								871 476 285.77	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Global Short-term

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Anleihen									
Aadb 5.5% 23-12.01.29	5.500	12.01.29	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Afrexbk 2.634% 21-17.05.26 Regs	2.634	17.05.26	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 876 960.00	0.89
Afrexbk 4.125% 17-20.06.24	4.125	20.06.24	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Afrexbk 5.25% 18-11.10.23	5.250	11.10.23	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Africa Fina 1.205% 20-30.09.25	1.205	30.09.25	CHF	-	1 000 000	-	1 000 000	1 092 031.85	0.52
Africa Fina 3.125% 20-16.06.25	3.125	16.06.25	USD	3 000 000	-	-2 500 000	500 000	484 842.63	0.23
Alibaba Grp 3.6% 15-28.11.24	3.600	28.11.24	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 983 882.82	0.94
Angl Ash Hd 3.75% 20-01.10.30	3.750	01.10.30	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	874 114.85	0.41
Axiata Spv2 4.357% 16-24.03.26	4.357	24.03.26	USD	500 000	-	-	500 000	491 631.25	0.23
B Latinam C 2.375% 20-14.09.25	2.375	14.09.25	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Baidu Inc 3.875% 18-29.09.23	3.875	29.09.23	USD	2 180 000	-	-2 180 000	-	-	0.00
Baidu Inc 4.375% 18-14.05.24	4.375	14.05.24	USD	3 400 000	-	-3 400 000	-	-	0.00
Banbra 6% 24-18.03.31	6.000	18.03.31	USD	-	1 250 000	-	1 250 000	1 224 625.00	0.58
Banco 4.375% 11.04.27 Regs	4.375	11.04.27	USD	800 000	-	-	800 000	774 859.92	0.37
Banco Bbva 6.2% 24-07.06.34	6.200	07.06.34	USD	-	1 440 000	-	1 440 000	1 445 104.80	0.68
Banco De 3.5% 17-12.10.27 Regs	3.500	12.10.27	USD	1 800 000	-	-	1 800 000	1 699 651.26	0.80
Banco Inbuv 4.125% 14-06.06.24	4.125	06.06.24	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Banco Nacio 2.72% 21-11.08.31	2.720	11.08.31	USD	-	2 200 000	-	2 200 000	1 961 630.00	0.93
Banco Peru 3.25% 19-04.10.26 Regs	3.250	04.10.26	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Banco Peru 6.625 (Frn) 19.03.29	6.625	19.03.29	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Banco Vot 4.375% 29.07.25 Regs	4.375	29.07.25	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 960 206.40	0.93
Bancolumbia 3.0% 20-29.01.25	3.000	29.01.25	USD	3 500 000	-	-3 500 000	-	-	0.00
Bank Mandir 2.0% 21-19.04.26	2.000	19.04.26	USD	500 000	-	-	500 000	468 840.00	0.22
Bank Mandir 4.75% 20-13.05.25	4.750	13.05.25	USD	800 000	-	-	800 000	793 595.20	0.37
Bank Mandir 5.50% 23-04.04.26	5.500	04.04.26	USD	500 000	-	-	500 000	499 965.47	0.24
Bank Pekao 5.5% 23-23.11.27	5.500	23.11.27	EUR	-	1 500 000	-	1 500 000	1 641 276.61	0.78
Bank Rakyat 4.625% 18-20.07.23	4.625	20.07.23	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Banort 0.50% 20-06.12.24	0.500	06.12.24	CHF	1 000 000	-	-	1 000 000	1 102 548.21	0.52
Bbva Bancom 4.375% 14-10.04.24	4.375	10.04.24	USD	4 300 000	-	-4 300 000	-	-	0.00
Bharat Petr	4.000	08.05.25	USD	800 000	-	-	800 000	789 608.00	0.37
Bharti Airt 4.375% 15-10.06.25	4.375	10.06.25	USD	2 320 000	2 000 000	-2 320 000	2 000 000	1 979 068.14	0.93
Bk Of China	5.000	13.11.24	USD	2 850 000	-	-2 850 000	-	-	0.00
Bnk Gosp Kr 6.25% 23-31.10.28	6.250	31.10.28	USD	-	600 000	-600 000	-	-	0.00
Boad 5% 17-27.07.27 Regs	5.000	27.07.27	USD	1 000 000	1 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Boc Aviatio 2.625% 20-17.01.25	2.625	17.01.25	USD	300 000	-	-	300 000	295 299.00	0.14
Bpnl Intern 4.375% 17-18.01.27	4.375	18.01.27	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Bradesco 3.20% 20-27.01.25	3.200	27.01.25	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 473 374.70	0.70
Bsf Sukuk 5% 24-25.01.29	5.000	25.01.29	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 482 187.50	0.70
Cemex 3.875% 21-11.07.31 Regs	3.875	11.07.31	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	882 468.40	0.42
Cencosud 4.375% 17-17.07.27	4.375	17.07.27	USD	-	1 100 000	-	1 100 000	1 058 159.41	0.50
Cencosud 5.15% 15-12.02.25	5.150	12.02.25	USD	3 100 000	-	-1 100 000	2 000 000	1 998 968.20	0.94
Cencosud 5.95% 24-28.05.31	5.950	28.05.31	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	1 004 840.00	0.47
Ceska Spo 4.57% 24-03.07.31	4.570	03.07.31	EUR	-	1 200 000	-	1 200 000	1 282 531.39	0.61
Chile 4.85% 24-22.01.29	4.850	22.01.29	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Cnac Hk Fin 1.125% 20-22.09.24	1.125	22.09.24	EUR	2 000 000	-	-	2 000 000	2 127 114.01	1.00
Cofide 4.75% 15-15.07.25	4.750	15.07.25	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Colombia 8.125% 04-21.05.24	8.125	21.05.24	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Compet Team 3.75% 19-12.03.24	3.750	12.03.24	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Credito 3.125% 20-01.07.30	3.125	01.07.30	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	963 923.80	0.46
Croatia 6% 13-26.01.24	6.000	26.01.24	USD	2 000 000	3 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
Ct Trust 5.125% 22-03.02.32 Regs	5.125	03.02.32	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 763 745.00	0.83
Dbs Group 4.52% 18-11.12.28	4.520	11.12.28	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Dbs Group 5.479% 12.09.25 Regs	5.479	12.09.25	USD	-	1 400 000	-1 400 000	-	-	0.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Global Short-term (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Doha Fin 2.375% 21-31.03.26	2.375	31.03.26	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 893 013.00	0.89
Dp World Sa 6.0% 20-Perp	6.000	31.12.99	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Ecopetrol 4.125% 14-16.01.25	4.125	16.01.25	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Ecopetrol 5.375% 15-26.06.26	5.375	26.06.26	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Ecopetrol 6.875% 20-29.04.30	6.875	29.04.30	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 923 499.20	0.91
Emg Sukuk	4.564	18.06.24	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Emirate20 370-S Frn 5.625% 22- 21.10.27	5.625	21.10.27	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Emirate20 Frn 2.625% 18.02.25	2.625	18.02.25	USD	300 000	-	-	300 000	293 654.40	0.14
Emirates Nbdfrn 5.875% 11.10.28	5.875	11.10.28	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Empresa Nac 3.75% 16-05.08.26	3.750	05.08.26	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 918 870.80	0.91
Eximbank 6% 23-16.05.29	6.000	16.05.29	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	1 128 619.73	0.53
Eximbank 6.125% 23-04.12.27	6.125	04.12.27	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Fibria 4% 17-14.01.25	4.000	14.01.25	USD	3 800 000	-	-3 800 000	-	-	0.00
First 5.125% 22-13.10.27	5.125	13.10.27	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Flex Ltd 4.875% 19-15.06.29	4.875	15.06.29	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 454 681.18	0.69
Formosa	3.375	22.04.25	USD	750 000	-	-	750 000	736 340.63	0.35
Geely Finan 3.0% 20-05.03.25	3.000	05.03.25	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 958 889.20	0.93
Gf Orogen 5.125% 19-15.05.24	5.125	15.05.24	USD	1 750 000	700 000	-2 450 000	-	-	0.00
Gf Orogen 6.125% 19-15.05.29	6.125	15.05.29	USD	-	2 450 000	-1 450 000	1 000 000	1 013 671.70	0.48
Gnl Quinter 4.634% 14-29 /Pool	4.634	31.07.29	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	948 291.13	0.45
Gohl Cap 4.25% 17-24.01.27 Regs	4.250	24.01.27	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 921 655.62	0.91
Grp Televis 4.625% 15-30.01.26	4.625	30.01.26	USD	3 145 000	-	-3 145 000	-	-	0.00
Gruma 4.875% 14-01.12.24	4.875	01.12.24	USD	1 575 000	-	-	1 575 000	1 566 881.69	0.74
Grupo Energ 4.875% 20-15.05.30 Regs	4.875	15.05.30	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 905 736.80	0.90
Gs-Caltex 4.50% 22-05.01.26	4.500	05.01.26	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Guatemala 4.5% 16-03.05.26	4.500	03.05.26	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Haidilao 2.15% 21-14.01.26	2.150	14.01.26	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	946 085.00	0.45
Hana Bank 4.375% 14-30.09.24	4.375	30.09.24	USD	3 500 000	-	-	3 500 000	3 487 297.38	1.65
Hpht Fi 2.875% 19-05.11.24	2.875	05.11.24	USD	500 000	-	-	500 000	494 926.83	0.23
Hungary 5.75% 13-22.11.23	5.750	22.11.23	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Hungary 6.125% 23-22.05.28	6.125	22.05.28	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Hunt 6.375% 18-01.06.28 /Pool Regs	6.375	01.06.28	USD	1 500 000	2 500 000	-2 000 000	2 000 000	1 481 406.82	0.70
Hyund Cap 2.65% 20-10.02.25	2.650	10.02.25	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Hyund Cap 5.50% 23-30.03.26	5.500	30.03.26	USD	3 000 000	-	-1 500 000	1 500 000	1 499 275.40	0.71
Hyund Cap 5.60% 23-30.03.28	5.600	30.03.28	USD	1 500 000	-	-500 000	1 000 000	1 007 565.10	0.48
Hyundai Mtr 1.75% 21-06.05.26	1.750	06.05.26	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Icici Bk D 4% 16-18.03.26	4.000	18.03.26	USD	2 300 000	-	-	2 300 000	2 247 887.18	1.06
Indofood 3.398% 21-09.06.31	3.398	09.06.31	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 308 798.00	0.62
Inversiones 4.75% 14-15.09.24	4.750	15.09.24	USD	3 250 000	-	-	3 250 000	3 242 474.30	1.53
Johnson Ele 4.125% 19-30.07.24	4.125	30.07.24	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	998 603.83	0.47
Kalpa Gn 4.125% 17-16.08.27 Reg	4.125	16.08.27	USD	2 000 000	-	-1 000 000	1 000 000	955 350.70	0.45
Kazmunaygas 4.75% 19.04.27 Regs	4.750	19.04.27	USD	2 000 000	1 000 000	-1 500 000	1 500 000	1 452 299.25	0.69
Kbank Hk 3.256% 18-12.07.23 Regs	3.256	12.07.23	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Kbank Hk 5.275% 20-Perp	5.275	31.12.99	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 464 262.50	0.69
Kbank Hk 5.458% 23-07.03.28	5.458	07.03.28	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Korea Exch 4.25% 14-14.10.24	4.250	14.10.24	USD	500 000	-	-	500 000	497 672.75	0.23
Koroil 4.75% 23-03.04.26	4.750	03.04.26	USD	2 000 000	-	-1 000 000	1 000 000	991 403.00	0.47
Kr Watr Res 3.50% 22-27.04.25	3.500	27.04.25	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	985 155.00	0.47
Kt Corp 4.0% 22-08.08.25	4.000	08.08.25	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Lamar Fund 3.958% 15-07.05.25	3.958	07.05.25	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 958 387.50	0.92
Lenovo Grp 5.875% 20-24.04.25	5.875	24.04.25	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	1 001 577.50	0.47
Lotte P&D 4.50% 22-01.08.25	4.500	01.08.25	USD	1 400 000	-	-	1 400 000	1 385 557.81	0.65
Maf Glb Sec 6.375% 18-Perp	6.375	31.12.99	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 482 809.63	0.70
Mashreqbk 7.875% 22-24.02.33	7.875	24.02.33	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Mauritius C 7.95% 23-26.04.28	7.950	26.04.28	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Mexico Cete 5.40% 23-09.02.28	5.400	09.02.28	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Millicom Ic 6.625% 18-15.10.26	6.625	15.10.26	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Global Short-term (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Misc Cap 3.75% 22-06.04.27 Regs	3.750	06.04.27	USD	1 345 000	-	-	1 345 000	1 286 202.67	0.61
Mivivi 4.265% 22-12.04.27 Regs	4.625	12.04.27	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 459 405.13	0.69
Morocco 5.95% 23-08.03.28 Regs	5.950	08.03.28	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Myriad Intl 4.85% 17-06.07.27 Regs	4.850	06.07.27	USD	3 500 000	-	-	3 500 000	3 406 476.50	1.61
Nat Kazak 3.25% 18-05.12.23	3.250	05.12.23	CHF	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Nbk Tier 2 2.50% 20-24.11.30	2.500	24.11.30	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	946 623.00	0.45
Nccc 2.50% 20-21.10.27	2.500	21.10.27	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	904 590.00	0.43
Nonghyup Bk 4.25% 22-06.07.27	4.250	06.07.27	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Nova Kbm 4.75% 24-03.04.28	4.750	03.04.28	EUR	-	800 000	-	800 000	861 489.80	0.41
Nova Ljubl 4.5% 24-29.05.30	4.500	29.05.30	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	1 067 893.84	0.50
Nova Ljubl 7.125% 23-27.06.27	7.125	27.06.27	EUR	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Office Cher 4.5% 15-22.10.25	4.500	22.10.25	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	981 860.00	0.46
Office Cher 5.625% 14-25.04.24	5.625	25.04.24	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Otp Bank 5% 24-31.01.29 Regs	5.000	31.01.29	EUR	-	2 000 000	-	2 000 000	2 154 894.20	1.02
Otp Bank 7.50% 23-25.05.27	7.500	25.05.27	USD	2 500 000	-	-1 500 000	1 000 000	1 026 052.00	0.48
Panama 8.875% 97-30.09.27	8.875	30.09.27	USD	2 426 000	-	-1 226 000	1 200 000	1 299 426.12	0.61
Pauay 4.95% 20-28.04.31 /Pool	4.950	28.04.31	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Per Pe Sbsn 4.40% 22-06.06.27	4.400	06.06.27	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Pertamina 1.40% 21-09.02.26	1.400	09.02.26	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 870 627.00	0.88
Philippne N 3.28% 19-27.09.24	3.280	27.09.24	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 489 753.91	0.70
Pko Bank 4.5% 24-18.06.29	4.500	18.06.29	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	1 072 489.51	0.51
Pko Bank 4.5% 24-27.03.28	4.500	27.03.28	EUR	-	2 000 000	-1 000 000	1 000 000	1 073 667.47	0.51
Pko Bank 5.625% 23-01.02.26	5.625	01.02.26	EUR	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
Puma Intl 7.75% 24-25.04.29	7.750	25.04.29	USD	-	1 500 000	-500 000	1 000 000	1 010 281.20	0.48
Qnb Fin 4.875% 24-30.01.29	4.875	30.01.29	USD	-	3 500 000	-2 000 000	1 500 000	1 481 437.50	0.70
Qtel Int Fi 5% 10-19.10.25 Reg-S	5.000	19.10.25	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Raiffeisenb 4.959% 24-05.06.30	4.959	05.06.30	EUR	-	2 000 000	-	2 000 000	2 144 649.34	1.01
Raiffeisenb 7.125% 23-19.01.26	7.125	19.01.26	EUR	1 700 000	-	-1 700 000	-	-	0.00
Raizn Fuel 5.3% 17-20.01.27 Regs	5.300	20.01.27	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Raizn Fuel 6.45% 05.03.34 Regs	6.450	05.03.34	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Rakfunding 4.125% 19-09.04.24	4.125	09.04.24	USD	2 300 000	-	-2 300 000	-	-	0.00
Rec Ltd 5.25% 18-13.11.23	5.250	13.11.23	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Reliance In	4.125	28.01.25	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 982 805.16	0.94
Rizal Comm Bk C 5.5% 24-18.01.29	5.500	18.01.29	USD	-	600 000	-600 000	-	-	0.00
Rizal Commer Bk 3% 19-11.09.24	3.000	11.09.24	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 490 793.00	0.70
Romania 5.0% 22-27.09.26	5.000	27.09.26	EUR	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Romania 5.375% 24-22.03.31	5.375	22.03.31	EUR	-	1 500 000	-	1 500 000	1 598 226.82	0.75
Rural Elec 3.375% 19-25.07.24	3.375	25.07.24	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Rural Elec 5.625% 23-11.04.28	5.625	11.04.28	USD	1 500 000	2 500 000	-1 200 000	2 800 000	2 817 444.00	1.33
Samba Fdg 2.75% 19-02.10.24	2.750	02.10.24	USD	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Sands China 3.75% 22-08.08.31	3.250	08.08.31	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 264 652.10	0.60
Sands China 5.125% 18-08.08.25	5.125	08.08.25	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 983 978.40	0.94
Santander 5.375% 20-17.04.25 Regs	5.375	17.04.25	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 989 009.17	1.41
Sb Capital 5.25% 13-23.05.23	5.250	23.05.23	USD	2 500 000	-	-	2 500 000	-	0.00
Shinhan Bk 3.875% 16-24.03.26	3.875	24.03.26	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 941 265.72	0.92
Shriram Fin 6.625% 24-22.04.27	6.625	22.04.27	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	1 001 772.00	0.47
Sigma 2.625% 17-07.02.24 Regs	2.625	07.02.24	EUR	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Sigma 4.125% 16-02.05.26	4.125	02.05.26	USD	1 000 000	1 500 000	-2 500 000	-	-	0.00
Sk Hynix 6.25% 23-17.01.26	6.250	17.01.26	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	2 022 210.00	0.96
Sk On Co Lt 5.375% 23-11.05.26	5.375	11.05.26	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	999 135.00	0.47
Slovenska S 5.375% 23-04.10.28	5.375	04.10.28	EUR	-	2 000 000	-	2 000 000	2 203 492.28	1.04
Snb Sukuk L 5.129% 24-27.02.29	5.129	27.02.29	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 987 587.50	0.94
South Africa 4.665% 12-17.01.24	4.665	17.01.24	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Spdb Hk Frn 20-27.07.23	0.000	27.07.23	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
St Bk India 4.375% 24-01.24 Regs	4.375	24.01.24	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
St Bk India 4.875% 23-05.05.28	4.875	05.05.28	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	990 540.00	0.47
St Bk India 5% 24-17.01.29	5.000	17.01.29	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 986 643.00	0.94
St Marys 5.75% 16-28.01.27	5.750	28.01.27	USD	2 204 000	-	-2 204 000	-	-	0.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Global Short-term (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Std Chart 6.17% 23-09.01.27	6.170	09.01.27	USD	3 000 000	-	-1 000 000	2 000 000	2 014 059.40	0.95
Std Chart 7.776% 22-16.11.25	7.776	16.11.25	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	3 020 528.10	1.43
Suam Fin 4.875% 14-17.04.24	4.875	17.04.24	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Susano Aust 5.75% 16-14.07.26	5.750	14.07.26	USD	300 000	-	-	300 000	300 569.10	0.14
Suzano Inter 4.0% 17-14.01.25	4.000	14.01.25	USD	-	3 800 000	-1 800 000	2 000 000	1 978 867.60	0.93
Swire Pac 3.875% 15-21.09.25	3.875	21.09.25	USD	1 700 000	-	-	1 700 000	1 669 487.55	0.79
Swire Pac 4.5% 13-09.10.23	4.500	09.10.23	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Tencent Hol 1.81% 20-26.01.26	1.810	26.01.26	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Tower B Inf 2.75% 21-20.01.26	2.750	20.01.26	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 430 865.00	0.68
Tower B Inf 4.25% 20-21.01.25	4.250	21.01.25	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	991 625.00	0.47
Trinidad & 4.375% 13-16.01.24	4.375	16.01.24	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Trust F 5.25% 14-15.12.24 Regs	5.250	15.12.24	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Usa 4.5% 24-31.05.29 /Tbo	4.500	31.05.29	USD	-	3 000 000	-	3 000 000	3 022 734.30	1.43
Usa 4.75% 23-31.07.25 /Tbo	4.750	31.07.25	USD	-	10 000 000	-10 000 000	-	-	0.00
Vietnam 4.8% 14-19.11.24	4.800	19.11.24	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Weibo 3.5% 19-05.07.24	3.500	05.07.24	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	2 002 098.20	0.95
Woori Bk	4.750	30.04.24	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
								154 257 861.97	72.89

Schatzwechsel

Usa 0% 23-30.05.24 Tb		30.05.24	USD	-	15 000 000	-15 000 000	-	-	0.00
								-	0.00

Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind **154 257 861.97** **72.89**

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Anleihen

Abq Finance 1.875% 20-08.09.25	1.875	08.09.25	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 910 742.50	0.90
Abq Finance 3.125% 19-24.09.24	3.125	24.09.24	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 490 613.75	0.70
Ambipar Lux 9.875% 24-06.02.31 Regs	9.875	06.02.31	USD	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Arauco	4.500	01.08.24	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 995 329.90	1.42
Banco Peru 7.625% 24-16.01.34	7.625	16.01.34	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 590 600.00	0.75
Bangkok Bk 4.30% 22-15.06.27	4.300	15.06.27	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Bbva 5.862% 22-14.09.26	5.862	14.09.26	USD	-	2 400 000	-	2 400 000	2 400 899.76	1.13
Bco Con Sae 2.75% 20-10.12.25 Regs	2.750	10.12.25	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	951 054.60	0.45
Bco Dest Cl 2.704% 20-09.01.25	2.704	09.01.25	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 963 320.00	0.93
Bdo Unibank 2.125% 20-13.01.26	2.125	13.01.26	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Bea 6.625% 24-13.03.27	6.625	13.03.27	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	1 005 895.00	0.48
Bk Cn Macau Frn 22-28.04.25	6.125	28.04.25	USD	3 000 000	2 000 000	-4 000 000	1 000 000	1 002 512.00	0.47
Bk Leumi 5.125% 22-27.07.27	5.125	27.07.27	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Boc Aviatio 3.25% 20-29.04.25 Regs	3.250	29.04.25	USD	3 000 000	-	-2 000 000	1 000 000	980 774.50	0.46
Boc Aviatio 5.75% 23-09.11.28	5.750	09.11.28	USD	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Bocom Leasi Frn 20-02.03.25	6.550	02.03.25	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	1 002 183.50	0.47
Ccbl 1.99% 20-21.07.25	1.990	21.07.25	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 927 640.00	0.91
Credicorp 2.75% 20-17.06.25 Regs	2.750	17.06.25	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 943 308.50	0.92
Credito 5.85% 24-11.01.29	5.850	11.01.29	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	2 025 966.00	0.96
Csn Res 8.875% 23-05.12.30	8.875	05.12.30	USD	-	1 200 000	-	1 200 000	1 194 616.32	0.56
Far East Ho 6.625% 24-16.04.27	6.625	16.04.27	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	1 004 419.40	0.47
Fwd Grp Hld 7.635% 24-02.07.31	7.635	02.07.31	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	1 015 705.00	0.48
Hanwha Tota 5.5% 24-18.07.29	5.500	18.07.29	USD	-	2 000 000	-1 000 000	1 000 000	999 972.40	0.47
Hdfc Bk 5.686% 23-02.03.26	5.686	02.03.26	USD	3 000 000	2 000 000	-3 000 000	2 000 000	2 005 880.00	0.95
Hk Mtg Co 4.875% 23-13.09.28	4.875	13.09.28	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Hyund Cap 5.80% 23-26.06.25	5.800	26.06.25	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	2 002 802.00	0.95
Israel Dis 5.375% 23-26.01.28	5.375	26.01.28	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Kfh Sukuk C 5.011% 17.01.029	5.011	17.01.29	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 480 546.88	0.70
Korea Gas 4.875% 23-05.07.28	4.875	05.07.28	USD	1 500 000	1 500 000	-1 000 000	2 000 000	1 995 197.00	0.94

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Global Short-term (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Korearehabn 4.125% 22-20.04.27	4.125	20.04.27	USD	3 000 000	-	-2 000 000	1 000 000	969 244.39	0.46
Koroil Frn 23-14.11.26	6.425	14.11.26	USD	-	800 000	-	800 000	812 481.60	0.38
Metalsa Sa 3.75% 21-04.05.31	3.750	04.05.31	USD	-	1 500 000	-	1 500 000	1 197 479.40	0.57
Misc Cap Two 3.625% 22-06.04.25	3.625	06.04.25	USD	1 700 000	800 000	-	2 500 000	2 462 294.88	1.16
Qib Sukuk Frn 20-07.02.25	6.947	07.02.25	USD	1 300 000	-	-	1 300 000	1 310 133.50	0.62
Shinhan Bk Frn 20-24.04.25 Regs	7.284	24.04.25	USD	200 000	-	-	200 000	201 777.42	0.10
Sk Telecom 6.625% 07-20.07.27	6.625	20.07.27	USD	1 560 000	-	-	1 560 000	1 620 345.01	0.77
Std Chart Frn 23-06.07.27	7.284	06.07.27	USD	3 500 000	-	-	3 500 000	3 564 331.40	1.68
Ultra Int	5.250	06.10.26	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 945 173.20	0.92
Vivo Energy 5.125% 20-24.09.27	5.125	24.09.27	USD	-	2 000 000	-	2 000 000	1 884 490.00	0.89
Warba Sukuk 2.982% 19-24.09.24	2.982	24.09.24	USD	500 000	-	-	500 000	497 012.88	0.24
Wharf Reic 2.375% 20-07.05.25	2.375	07.05.25	USD	1 300 000	-	-	1 300 000	1 265 298.45	0.60
							52 620 041.14	24.86	
Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere								52 620 041.14	24.86
SUMME WERTPAPIERBESTAND								206 877 903.11	97.75
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								4 537 724.92	2.14
Sonstige Aktiven								224 533.57	0.11
GESAMTNETTOVERMÖGEN								211 640 161.60	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond CHF

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in CHF	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Anleihen									
Aadb Ky 0.50% 19-29.11.24	0.500	29.11.24	CHF	300 000	-	-	300 000	299 101.50	1.52
Afd 2.625% 12-18.02.25	2.625	18.02.25	CHF	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Akademiska 0.3% 17-08.10.29	0.300	08.10.29	CHF	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Akademiska 0.65% 18-08.02.44	0.650	08.02.44	CHF	300 000	-	-100 000	200 000	178 550.00	0.91
Akademiska 1.992% 23-14.03.33	1.992	14.03.33	CHF	150 000	-	-	150 000	160 200.00	0.81
Apple Inc	0.375	25.11.24	CHF	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
At&T Inc 1.375% 14-04.12.24	1.375	04.12.24	CHF	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Auchan	1.500	03.06.24	CHF	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Auckland Co 1.56% 23-30.11.29	1.560	30.11.29	CHF	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Bawag Psk 2.052% 23-14.04.28	2.052	14.04.28	CHF	200 000	-	-	200 000	205 421.22	1.04
Bc Sant Cl 0.33% 21-22.06.27	0.330	22.06.27	CHF	200 000	-	-	200 000	191 500.00	0.97
Bco Chile 0.575% 17-07.04.27	0.575	07.04.27	CHF	300 000	-	-	300 000	290 175.00	1.47
Bei 3.125% 06-30.06.36	3.125	30.06.36	CHF	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Bfcm 1.50% 22-01.06.27	1.500	01.06.27	CHF	300 000	-	-	300 000	301 575.00	1.53
Bfcm 2.223% 24-30.01.32	2.223	30.01.32	CHF	-	400 000	-100 000	300 000	310 125.00	1.57
Bk Scotia 0.278% 22-01.04.27	0.278	01.04.27	CHF	200 000	-	-	200 000	195 350.00	0.99
Bk Scotia 0.385% 22-01.02.29	0.385	01.02.29	CHF	200 000	-	-	200 000	190 600.00	0.97
Bk Scotia 2.142% 23-03.05.30	2.142	03.05.30	CHF	-	200 000	-	200 000	211 100.00	1.07
Black Sea T 0.35% 21-15.03.27	0.350	15.03.27	CHF	300 000	-	-	300 000	266 550.00	1.35
Bnp Par 2.412% 23-13.01.28	2.412	13.01.28	CHF	200 000	-	-	200 000	205 650.00	1.04
Bpce 2.045% 24-15.03.32	2.045	15.03.32	CHF	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Ca Home Ln 1.825% 23-26.05.28	1.825	26.05.28	CHF	200 000	-	-	200 000	205 200.00	1.04
Cabei 0.17% 21-29.09.31	0.170	29.09.31	CHF	300 000	-	-	300 000	267 525.00	1.36
Cbq Finance 0.735% 20-27.11.24	0.735	27.11.24	CHF	400 000	-	-200 000	200 000	199 300.00	1.01
Cellnex Tel 0.775% 20-18.02.27	0.775	18.02.27	CHF	500 000	-	-300 000	200 000	195 350.00	0.99
Cibc 0.968% 22-26.04.29	0.968	26.04.29	CHF	-	300 000	-	300 000	297 450.00	1.51
Co Fin 1.903% 23-16.06.28	1.903	16.06.28	CHF	200 000	-	-	200 000	205 700.00	1.04
Comzbnk 3.80% 23-03.05.28	3.800	03.05.28	CHF	-	200 000	-	200 000	212 436.42	1.08
Corp Andina 0.45% 22-24.02.27	0.450	24.02.27	CHF	200 000	-	-	200 000	194 400.00	0.99
Corp Andina 0.70% 20-04.09.25	0.700	04.09.25	CHF	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Corp Andina 2.428% 23-15.02.30	2.428	15.02.30	CHF	200 000	-	-	200 000	207 740.00	1.05
Cred Agric 3.042% 22-29.09.27	3.042	29.09.27	CHF	200 000	200 000	-	400 000	416 900.00	2.12
Credito 0.599% 22-26.04.27	0.599	26.04.27	CHF	300 000	-	-	300 000	289 650.00	1.47
Deutsch Bah 0.5% 18-18.07.28	0.500	18.07.28	CHF	300 000	-	-	300 000	292 800.00	1.49
Dnb Bank As 1.168% 22-03.06.27	1.168	03.06.27	CHF	200 000	-	-	200 000	198 750.00	1.01
Dt Bahn Fin 2.285% 22-28.11.42	2.285	28.11.42	CHF	400 000	-	-200 000	200 000	230 700.00	1.17
Dz Bk Zentr 2.625% 23-27.08.29	2.625	27.08.29	CHF	200 000	-	-	200 000	207 408.06	1.05
Ebn	0.875	22.09.26	CHF	250 000	-	-	250 000	248 937.50	1.26
Eibk 2.018% 23-14.11.28	2.018	14.11.28	CHF	-	200 000	-	200 000	206 150.00	1.05
Eli Lilly	0.150	24.05.24	CHF	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Eli Lilly	0.450	24.05.28	CHF	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Enel Fin 0.55% 17-03.09.24	0.550	03.09.24	CHF	-	300 000	-	300 000	299 580.00	1.52
Erste Bk 0.25% 21-02.10.28	0.250	02.10.28	CHF	200 000	-	-	200 000	189 450.00	0.96
First 0.205% 19-04.12.25	0.205	04.12.25	CHF	300 000	-	-	300 000	294 540.00	1.49
Heathrow Fd 1.80% 22-27.05.27	1.800	27.05.27	CHF	200 000	-	-	200 000	202 450.00	1.03
Hypo Noe Gr 0.10% 19-27.11.24	0.100	27.11.24	CHF	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Hyucap 2.748% 23-11.05.26	2.748	11.05.26	CHF	-	200 000	-	200 000	203 900.00	1.03
Ico	3.250	28.06.24	CHF	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Itau Bba In 0.56% 22-17.02.25	0.560	17.02.25	CHF	200 000	-	-	200 000	198 673.69	1.01
Jackson Nat 0.125% 20-14.07.28	0.125	14.07.28	CHF	200 000	-	-	200 000	186 900.00	0.95
Kfw	2.500	25.08.25	CHF	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Kfw 2.75% 07-16.02.37	2.750	16.02.37	CHF	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Kommkrdt	2.875	13.10.31	CHF	300 000	-	-100 000	200 000	225 950.00	1.15

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond CHF (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in CHF	% des Netto- vermögens
Kommunalbk 1.275% 22-22.12.27	1.275	22.12.27	CHF	200 000	-	-	200 000	201 900.00	1.02
Kr Hous Fin 2.465% 22-14.10.27	2.465	14.10.27	CHF	200 000	-	-	200 000	207 900.00	1.05
Ldkr B-W 2.39% 24-08.02.29 Regs	2.390	08.02.29	CHF	-	200 000	-	200 000	203 900.00	1.03
Macquarie G 0.395% 21-20.07.28	0.395	20.07.28	CHF	300 000	-	-	300 000	287 394.38	1.46
Met Life 0.15% 21-25.09.29	0.150	25.09.29	CHF	-	300 000	-	300 000	282 150.00	1.43
Munhyps 0.25% 19-10.05.30	0.250	10.05.30	CHF	400 000	-	-	400 000	378 900.00	1.92
Munhyps 0.35% 18-12.12.23	0.350	12.12.23	CHF	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Munhyps 0.55% 19-15.03.34	0.550	15.03.34	CHF	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Muni Fin	1.375	08.06.27	CHF	300 000	-	-100 000	200 000	202 350.00	1.03
N Brunswick 0.2% 16-07.11.31	0.200	07.11.31	CHF	-	200 000	-	200 000	185 900.00	0.94
Nat Bui Soc 1.520% 22-17.12.29	1.520	17.12.29	CHF	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Natl Bk 1.958% 22-03.11.27	1.958	03.11.27	CHF	200 000	-	-	200 000	204 900.00	1.04
Natwest Mar 0.898% 22-04.04.25	0.898	04.04.25	CHF	200 000	-	-	200 000	199 420.00	1.01
Nbaduh 0.3225% 18-27.09.23	0.323	27.09.23	CHF	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Nordea Bank 1.81% 22-15.06.27	1.810	15.06.27	CHF	200 000	-	-	200 000	202 300.00	1.03
North Am 0.55% 20-27.05.33	0.550	27.05.33	CHF	300 000	-	-	300 000	280 350.00	1.42
Nwb 0.235% 22-14.04.27	0.235	14.04.27	CHF	200 000	-	-	200 000	196 100.00	1.00
Ny Life Gbl 0.125% 20-11.09.29	0.125	11.09.29	CHF	-	300 000	-	300 000	281 475.00	1.43
Ny Life Gbl 1.875% 24-07.05.32	1.875	07.05.32	CHF	-	200 000	-	200 000	205 700.00	1.04
Oekb	2.875	25.02.30	CHF	300 000	-	-150 000	150 000	165 600.00	0.84
Quebec (Prov Of) 2.04% 09.05.33	2.040	09.05.33	CHF	-	200 000	-	200 000	215 150.00	1.09
Ratp 1.512% 24-06.03.36	1.512	06.03.36	CHF	-	200 000	-	200 000	202 900.00	1.03
Rbc 0.20% 21-22.09.31	0.200	22.09.31	CHF	200 000	-	-	200 000	182 700.00	0.93
Rbc 0.40% 22-05.10.26	0.400	05.10.26	CHF	200 000	-	-	200 000	196 650.00	1.00
Rbc 2.085% 23-31.03.28	2.085	31.03.28	CHF	200 000	-	-	200 000	206 450.00	1.05
San Con 2.732% 23-04.07.25	2.732	04.07.25	CHF	-	200 000	-	200 000	202 806.50	1.03
Santander 0.31% 21-09.06.28	0.310	09.06.28	CHF	-	300 000	-	300 000	287 100.00	1.46
Shb 1.25% 22-24.05.27	1.250	24.05.27	CHF	200 000	-	-	200 000	199 450.00	1.01
Snf Mobil 1.582% 24-07.02.39	1.582	07.02.39	CHF	-	200 000	-	200 000	205 700.00	1.04
Socgen 2.618% 23-27.02.30	2.618	27.02.30	CHF	200 000	-	-	200 000	209 200.00	1.06
Socgen 2.682% 23-19.10.29	2.683	19.10.29	CHF	-	200 000	-	200 000	209 600.00	1.06
Spbk 1 0.125% 19-11.12.25	0.125	11.12.25	CHF	300 000	-	-	300 000	295 083.00	1.50
Spbk Bolikr 0.508% 22-06.04.27	0.508	06.04.27	CHF	200 000	-	-	200 000	196 700.00	1.00
Tor Dom Bk 1.482% 24-30.01.29	1.482	30.01.29	CHF	-	200 000	-	200 000	202 850.00	1.03
Tor Dom Bk 1.99% 24-17.06.31	1.990	17.06.31	CHF	-	200 000	-	200 000	205 100.00	1.04
Toyota NI 2.12% 23-26.10.29	2.120	26.10.29	CHF	-	200 000	-	200 000	207 200.00	1.05
Transpw Nz 0.038% 21-16.03.29	0.038	16.03.29	CHF	-	200 000	-	200 000	190 050.00	0.96
Transurban 0.875% 21-19.11.31	0.875	19.11.31	CHF	400 000	-	-200 000	200 000	190 000.00	0.96
Ubs Ag Lond 2.33% 22-14.11.25	2.330	14.11.25	CHF	200 000	-	-	200 000	202 900.00	1.03
Unibail Rod	2.000	20.11.23	CHF	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Verizon Com 1% 17-30.11.27	1.000	30.11.27	CHF	200 000	-	-	200 000	197 700.00	1.00
Vodafone 0.375% 16-03.12.24	0.375	03.12.24	CHF	200 000	-	-	200 000	199 250.00	1.01
Vonovia 2.565% 24-14.02.29	2.565	14.02.29	CHF	-	100 000	-	100 000	102 525.00	0.52
Westpac Bk 1.802% 22-21.09.29	1.802	21.09.29	CHF	200 000	-	-	200 000	206 500.00	1.05
Westpac Bk0.3% 17-28.11.25 Regs	0.300	28.11.25	CHF	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Wplau	1.000	11.12.23	CHF	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
							17 283 542.27	87.67	
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind							17 283 542.27	87.67	

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Anleihen

Abn Amro Ba 2.505% 23-26.06.28	2.505	26.06.28	CHF	200 000	-	-	200 000	207 450.00	1.05
Bnp Par 0.528% 22-20.01.28	0.528	20.01.28	CHF	-	200 000	-	200 000	190 850.00	0.97
Cibc 0.18% 21-20.04.29	0.180	20.04.29	CHF	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Cibc 0.282% 22-03.02.27	0.282	03.02.27	CHF	200 000	-	-	200 000	193 950.00	0.98

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond CHF (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in CHF	% des Netto- vermögens
Engie 2.49% 23-04.07.31	2.490	04.07.31	CHF	200 000	-	-	200 000	209 250.00	1.06
Lloyds Bk 0.6025% 22-09.02.29	0.603	09.02.29	CHF	200 000	-	-	200 000	190 900.00	0.97
Santander 2.345% 24-03.07.31	2.345	03.07.31	CHF	-	100 000	-	100 000	102 597.16	0.52
								1 094 997.16	5.55
Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere								1 094 997.16	5.55
				01.07.2023			Schlussbestand 30.06.2024	CHF	
Sonstige übertragbare Wertpapiere									
Anleihen									
Bqe Postale 2.828% 23-12.07.30	2.828	12.07.30	CHF	200 000	-	-	200 000	211 100.00	1.07
Comwlth Ny 1.94% 23-26.06.30	1.940	26.06.30	CHF	300 000	-	-	300 000	313 350.00	1.59
								524 450.00	2.66
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere								524 450.00	2.66
SUMME WERTPAPIERBESTAND								18 902 989.43	95.88
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								840 751.16	4.26
Sonstige Passiven								-29 229.36	-0.14
GESAMTNETTOVERMÖGEN								19 714 511.23	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Euro Broad

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Anleihen									
A2A 0.625% 21-15.07.31	0.625	15.07.31	EUR	800 000	-	-700 000	100 000	80 066.75	0.04
Aareal Bk 4.50% 22-25.07.25	4.500	25.07.25	EUR	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Aareal Bk 5.875% 24-29.05.26	5.875	29.05.26	EUR	-	300 000	-	300 000	303 530.25	0.14
Abb Fin Bv 3.125% 24-15.01.29	3.125	15.01.29	EUR	-	200 000	-	200 000	198 670.80	0.09
Abb Fin Bv 3.375% 23-16.01.31	3.375	16.01.31	EUR	200 000	-	-	200 000	200 257.34	0.09
Abbott II F 0.375% 19-19.11.27	0.375	19.11.27	EUR	1 000 000	-	-900 000	100 000	91 286.63	0.04
Acciona Ene 5.125% 23-23.04.31	5.125	23.04.31	EUR	-	300 000	-	300 000	310 594.86	0.15
Achmea Bv 4.25% 15-Perp	4.250	31.12.99	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Adidas 3.125% 22-21.11.29 Regs	3.125	21.11.29	EUR	100 000	-	-	100 000	99 620.54	0.05
Adif Alta V 0.55% 20-30.04.30	0.550	30.04.30	EUR	1 300 000	-	-	1 300 000	1 101 706.13	0.52
Adif Alta V 0.95% 19-30.04.27	0.950	30.04.27	EUR	1 500 000	-	-	1 500 000	1 403 344.50	0.66
Aegon 5.625% 19-Perp	5.625	31.12.99	EUR	-	700 000	-700 000	-	-	0.00
Ageas Fin 3.875% 19-Perp Regs	3.875	31.12.99	EUR	-	2 600 000	-1 000 000	1 600 000	1 362 704.32	0.64
Ald Sa 4% 24-24.01.31	4.000	24.01.31	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Allianz 2.625% 20-Perp	2.625	31.12.99	EUR	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Alpha Bank 6.875% 23-27.06.29	6.875	27.06.29	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Apple Inc 1.375% 17-24.05.29	1.375	24.05.29	EUR	300 000	-	-200 000	100 000	92 683.75	0.04
Argentum (Frn) 4,375% 15-Perp	4.375	31.12.99	EUR	500 000	-	-	500 000	498 223.13	0.24
Ascendas Re 0.75% 21-23.06.28	0.750	23.06.28	EUR	-	750 000	-	750 000	656 647.50	0.31
Asr 3.625% 23-12.12.28	3.625	12.12.28	EUR	-	100 000	-100 000	-	-	0.00
Athora Hold 6.625% 23-16.06.28	6.625	16.06.28	EUR	700 000	-	-700 000	-	-	0.00
Atradius Fi 5.25% 14-23.09.44	5.250	23.09.44	EUR	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Auckland Co 0.25% 21-17.11.31	0.250	17.11.31	EUR	2 800 000	-	-2 500 000	300 000	242 514.00	0.11
Austria 2.1% 17-20.09.2117	2.100	20.09.17	EUR	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Axa Frn 03-..Perp.Emtn	3.430	31.12.99	EUR	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Axa Sa 6.375%(Frn) 24-Perp Regs	6.375	31.12.99	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	1 024 634.50	0.48
Ayvens Sa 4.875% 23-06.10.28	4.875	06.10.28	EUR	-	700 000	-	700 000	728 857.15	0.34
Banco Bpm 4.875% 24-17.01.30	4.875	17.01.30	EUR	-	400 000	-	400 000	409 392.00	0.19
Banco Cred 7.5% 23-14.09.29	7.500	14.09.29	EUR	-	100 000	-100 000	-	-	0.00
Bank Pekao 5.5% 23-23.11.27	5.500	23.11.27	EUR	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Bankinter 4.875% 23-13.09.31	4.875	13.09.31	EUR	-	300 000	-	300 000	313 888.95	0.15
Barry Calbt 4% 24-14.06.29	4.000	14.06.29	EUR	-	300 000	-	300 000	301 011.00	0.14
Basque Ctry 3.4% 24-30.04.34	3.400	30.04.34	EUR	-	800 000	-	800 000	795 498.00	0.38
Bayern 0.01% 20-18.01.35	0.010	18.01.35	EUR	2 500 000	-	-2 000 000	500 000	368 260.88	0.17
Bbva 3.5% 24-26.03.31	3.500	26.03.31	EUR	-	200 000	-	200 000	198 456.70	0.09
Bbva 3.875% 24-15.01.34	3.875	15.01.34	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Bco Sab 4.25% 24-13.09.30	4.250	13.09.30	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Bco Sab 5.125% 22-10.11.28	5.125	10.11.28	EUR	200 000	-	-	200 000	208 645.54	0.10
Bco Sab 6.00% 23-16.08.33 Regs	6.000	16.08.33	EUR	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Bcp 5.625% 23-02.10.26 Regs	5.625	02.10.26	EUR	-	500 000	-	500 000	509 597.50	0.24
Bcp 8.75% 22-05.03.33	8.750	05.03.33	EUR	-	500 000	-	500 000	558 123.75	0.26
Belfius Bk 3.625% 18-Perp	3.625	31.12.99	EUR	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Belfius Bk 3.75% 24-22.01.29	3.750	22.01.29	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Belfius Bk 3.875% 23-12.06.28	3.875	12.06.28	EUR	400 000	-	-300 000	100 000	101 476.37	0.05
Belfius Bk 4.125% 23-12.09.29	4.125	12.09.29	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Belgium 1.40% 22-22.06.53	1.400	22.06.53	EUR	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Berlin 2.75% 23-14.02.33	2.750	14.02.33	EUR	400 000	-	-	400 000	393 905.20	0.19
Bfcm 0.01% 21-07.03.25	0.010	07.03.25	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Bfcm 2.625% 22-06.11.29	2.625	06.11.29	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Bfcm 3.5% 24-15.05.31	3.500	15.05.31	EUR	-	200 000	-	200 000	197 741.50	0.09
Bfcm 4.125% 23-18.09.30	4.125	18.09.30	EUR	-	500 000	-	500 000	513 826.75	0.24
Bmw Fin 3.25% 23-22.07.30	3.250	22.07.30	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Bng 0.875% 19-17.10.35	0.875	17.10.35	EUR	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Euro Broad (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Bng 1.25% 22-30.03.37	1.250	30.03.37	EUR	-	2 000 000	-	2 000 000	1 581 462.00	0.75
Bng 3.25% 23-29.08.33	3.250	29.08.33	EUR	-	800 000	-	800 000	811 408.72	0.38
Bnp Par 4.125% 23-26.09.32 Regs	4.125	26.09.32	EUR	-	1 200 000	-1 200 000	-	-	0.00
Bnp Par 4.375% 23-13.01.29	4.375	13.01.29	EUR	-	500 000	-	500 000	509 088.75	0.24
Bnp Par 4.75% 23-13.11.32	4.750	13.11.32	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Bnp Par 7.375% 23-Perp	7.375	31.12.99	EUR	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Bpce 3.875% 24-25.01.36 Regs	3.875	25.01.36	EUR	-	100 000	-	100 000	99 472.90	0.05
Bpce 5.125% 23-25.01.35 Regs	5.125	25.01.35	EUR	-	500 000	-	500 000	510 684.10	0.24
Bpce Sfh 1.75% 22-27.05.32	1.750	27.05.32	EUR	600 000	-	-	600 000	538 741.80	0.25
Bper Banca 4.25% 24-20.02.30 Regs	4.250	20.02.30	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Bpifrance 3.5% 23-27.09.27	3.500	27.09.27	EUR	-	300 000	-	300 000	302 130.30	0.14
Bqe Postale 0.75% 21-02.08.32	0.750	02.08.32	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Bqe Postale 3.0% 21-Perp	3.000	31.12.99	EUR	-	2 000 000	-1 000 000	1 000 000	771 126.00	0.36
Brenntag 0.50% 21-06.10.29	0.500	06.10.29	EUR	100 000	-	-	100 000	85 081.20	0.04
Bundesobl-1 0.0% 20-15.08.30	0.000	15.08.30	EUR	-	3 000 000	-	3 000 000	2 599 815.12	1.23
Bupa Fin 5% 23-12.10.30 Regs	5.000	12.10.30	EUR	-	700 000	-500 000	200 000	209 832.72	0.10
By Lbk 1.0% 21-23.09.31	1.000	23.09.31	EUR	600 000	-	-600 000	-	-	0.00
By Lbk 3.75% 23-07.02.29	3.750	07.02.29	EUR	100 000	-	-	100 000	100 840.35	0.05
By Lbk 3.75% 24-14.02.31 Regs	3.750	14.02.31	EUR	-	1 200 000	-600 000	600 000	597 201.75	0.28
By Lbk 4.25% 23-21.06.27	4.250	21.06.27	EUR	300 000	-	-	300 000	305 502.75	0.14
By Lbk 7% 23-05.01.34 Regs	7.000	05.01.34	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
C Fr Fi Loc 3.125% 24-17.05.39 Regs	3.125	17.05.39	EUR	-	500 000	-	500 000	489 982.00	0.23
C Fr Fi Loc Frn 05-08.08.25	0.063	08.08.25	EUR	-	500 000	-	500 000	479 900.00	0.23
Cabei 4.125% 22-16.11.37	4.125	16.11.37	EUR	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Caixa Gd 2.875% 22-15.06.26	2.875	15.06.26	EUR	-	600 000	-	600 000	594 295.50	0.28
Caixabank 5% 23-19.07.29	5.000	19.07.29	EUR	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Caixabank 6.125% (Frn) 23-30.05.34	6.125	30.05.34	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Carls 4.25% 23-05.10.33 Regs	4.250	05.10.33	EUR	-	200 000	-	200 000	207 701.40	0.10
Cassa Depo 1.0% 20-11.02.30	1.000	11.02.30	EUR	3 000 000	-	-	3 000 000	2 561 869.50	1.21
Cassa Depo 1.0% 20-21.09.28	1.000	21.09.28	EUR	2 800 000	-	-	2 800 000	2 492 354.20	1.17
Cattol Ass 4.25% 17-14.12.47	4.250	14.12.47	EUR	300 000	-	-	300 000	298 456.73	0.14
Ceska Spo 4.57% 24-03.07.31	4.570	03.07.31	EUR	-	200 000	-	200 000	199 445.05	0.09
Ceska Spo 4.824% 15-01.30 Regs	4.824	15.01.30	EUR	-	400 000	-300 000	100 000	101 624.12	0.05
Ceska Spo 5.737% 23-08.03.28	5.737	08.03.28	EUR	-	100 000	-	100 000	103 339.75	0.05
Cfcm 4.81% 24-15.05.35	4.810	15.05.35	EUR	-	400 000	-	400 000	400 944.80	0.19
Cnp Ass. Frn 05-Perp.	3.593	31.12.99	EUR	-	500 000	-	500 000	470 500.00	0.22
Cnp Assuran 1.25% 27-01.29 Regs	1.250	27.01.29	EUR	100 000	-	-	100 000	88 584.85	0.04
Co Fin 0.50% 22-16.03.28	0.500	16.03.28	EUR	2 000 000	-	-	2 000 000	1 812 977.12	0.85
Co Fin 2.375% 22-15.03.30	2.375	15.03.30	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	958 223.25	0.45
Co Fin 3.625% 23-16.01.29	3.625	16.01.29	EUR	-	200 000	-	200 000	203 831.00	0.10
Coca Cola 0.375% 20-15.03.33	0.375	15.03.33	EUR	100 000	-	-	100 000	78 347.71	0.04
Com.Di Milano 4.019% 05-29.06.35	4.019	29.06.35	EUR	2 500 000	-	-	2 500 000	2 404 223.03	1.13
Comcast 0.75% 20-20.02.32	0.750	20.02.32	EUR	300 000	-	-	300 000	245 108.07	0.12
Comwith Ny 4.266% 24-04.06.34	4.266	04.06.34	EUR	-	500 000	-	500 000	501 402.50	0.24
Continental 3.625% 22-30.11.27	3.625	30.11.27	EUR	100 000	-	-	100 000	100 515.60	0.05
Covivio Sa 4.625% 23-05.06.32	4.625	05.06.32	EUR	-	200 000	-	200 000	203 323.24	0.10
Cppib Capit 0.875% 19-06.02.29	0.875	06.02.29	EUR	3 250 000	-	-	3 250 000	2 944 938.75	1.39
Cred Agric 4.125% 07-03.30 Regs	4.125	07.03.30	EUR	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Credem It 4.875% 23-26.03.30	4.875	26.03.30	EUR	-	500 000	-	500 000	520 289.25	0.25
Dbj 3.125% 23-13.04.28	3.125	13.04.28	EUR	200 000	-	-	200 000	199 360.00	0.09
De Volksban 1.75% 20-22.10.30	1.750	22.10.30	EUR	-	100 000	-	100 000	96 412.20	0.05
De Volksban 7.0% 22-Perp	7.000	31.12.99	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	998 350.00	0.47
Delta Lloyd	4.375	31.12.99	EUR	151 000	-	-151 000	-	-	0.00
Deut Kredbk 0.01% 21-23.02.26	0.010	23.02.26	EUR	965 000	-	-	965 000	911 400.76	0.43
Deut Kredbk 2.875% 24-21.03.36	2.875	21.03.36	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	968 216.00	0.46
Deutschlan 0.10% 15-04.33 /Infl	0.100	15.04.33	EUR	-	6 400 000	-6 399 000	1 000	1 165.66	0.00
Deutschland 0.0% 20-15.08.50	0.000	15.08.50	EUR	-	2 000 000	-	2 000 000	1 015 765.00	0.48
Deutschland 0.0% 21-15.08.52	0.000	15.08.52	EUR	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Euro Broad (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Deutschland 1.80% 22-15.08.53	1.800	15.08.53	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	825 794.00	0.39
Dgz Dekabk 4.125% 23-03.08.28	4.125	03.08.28	EUR	-	200 000	-	200 000	203 088.70	0.10
Diageo Cap 0.125% 20-28.09.28	0.125	28.09.28	EUR	1 000 000	-	-500 000	500 000	439 199.60	0.21
Dnb Bank As 4.5% 19.07.28 Regs	4.500	19.07.28	EUR	-	500 000	-	500 000	512 301.85	0.24
Dt Gen Hyp 3.0% 23-30.11.32	3.000	30.11.32	EUR	200 000	-	-	200 000	198 724.50	0.09
E.On 0.375% 20-29.09.27	0.375	29.09.27	EUR	100 000	-	-	100 000	91 199.75	0.04
E.On 1.625% 22-29.03.31	1.625	29.03.31	EUR	500 000	-	-	500 000	445 438.75	0.21
E.On 3.75% 23-01.03.29	3.750	01.03.29	EUR	-	100 000	-	100 000	101 723.77	0.05
East Japan 4.389% 23-05.09.43	4.389	05.09.43	EUR	-	250 000	-	250 000	259 546.25	0.12
Edp 3.875% 23-26.06.28	3.875	26.06.28	EUR	100 000	-	-	100 000	100 875.30	0.05
Edp ServiCi 4.375% 23-04.04.32	4.375	04.04.32	EUR	-	100 000	-	100 000	103 632.60	0.05
Eib 1.5% 17-15.11.47	1.500	15.11.47	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Eli Lilly 0.625% 19-01.11.31	0.625	01.11.31	EUR	100 000	-	-	100 000	83 259.86	0.04
Elia Group 5.85% 23-Perp	5.850	31.12.99	EUR	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Elisa Corp 4% 23-27.01.29	4.000	27.01.29	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Elm Bv 3.375% 17-29.09.47 Regs	3.375	29.09.47	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Elo 6% 23-22.03.29	6.000	22.03.29	EUR	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Enel Fin 1% 17-16.09.24	1.000	16.09.24	EUR	200 000	-	-	200 000	198 804.30	0.09
Enel Fin 3.875% 24-23.01.35	3.875	23.01.35	EUR	-	100 000	-	100 000	98 138.88	0.05
Enexis 0.75% 19-02.07.31 Regs	0.750	02.07.31	EUR	400 000	-	-	400 000	336 431.40	0.16
Enexis 3.625% 23-12.06.34	3.625	12.06.34	EUR	100 000	-	-	100 000	101 597.15	0.05
Epiroc 3.625% 24-28.02.31 Regs	3.625	28.02.31	EUR	-	100 000	-	100 000	98 950.40	0.05
EqT 2.875% 22-06.04.32	2.875	06.04.32	EUR	400 000	-	-	400 000	362 365.20	0.17
Ericsson 1.125% 22-08.02.27	1.125	08.02.27	EUR	100 000	-	-	100 000	93 720.20	0.04
Ericsson 5.375% 23-29.05.28	5.375	29.05.28	EUR	-	200 000	-	200 000	209 406.44	0.10
Erste Bk 3.375% 20-Perp	3.375	31.12.99	EUR	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Erste Bk 4.0% 23-16.01.31	4.000	16.01.31	EUR	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Erste Bk 4.25% 20-Perp	4.250	31.12.99	EUR	-	4 000 000	-4 000 000	-	-	0.00
Erste Bk 5.125% 19-Perp Regs	5.125	31.12.99	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Erste Bk 8.5% 23-Perp	8.500	31.12.99	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Erste&Steie 4.875% 24-31.01.29	4.875	31.01.29	EUR	-	400 000	-	400 000	407 151.48	0.19
Esb Fin 1.125% 19-11.06.30	1.125	11.06.30	EUR	100 000	-	-	100 000	87 473.40	0.04
Estonia Gov 3.25% 24-17.01.34	3.250	17.01.34	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	973 547.50	0.46
Eu 0.0% 20-04.07.35	0.000	04.07.35	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	713 033.55	0.34
Eu 0.0% 20-04.10.30	0.000	04.10.30	EUR	-	4 000 000	-	4 000 000	3 340 028.76	1.57
Eu 0.0% 21-02.06.28	0.000	02.06.28	EUR	4 000 000	-	-	4 000 000	3 574 560.00	1.68
Eu 0.30% 20-04.11.50	0.300	04.11.50	EUR	-	4 000 000	-	4 000 000	1 937 008.48	0.91
Eu 0.40% 21-04.02.37	0.400	04.02.37	EUR	1 200 000	1 000 000	-	2 200 000	1 565 245.00	0.74
Eu 2.625% 22-04.02.48	2.625	04.02.48	EUR	-	4 000 000	-	4 000 000	3 461 370.80	1.63
Eu 2.75% 22-04.02.33	2.750	04.02.33	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	977 692.50	0.46
Eu 3.375% 24-05.10.54 Regs	3.375	05.10.54	EUR	-	1 600 000	-	1 600 000	1 547 124.80	0.73
Eurofima 0.15% 19-10.10.34	0.150	10.10.34	EUR	600 000	-	-	600 000	448 002.89	0.21
Eurogrid 3.279% 22-05.09.31	3.279	05.09.31	EUR	100 000	-	-	100 000	97 298.65	0.05
Fidel Cia S 7.75% 24-Perp	7.750	31.12.99	EUR	-	2 000 000	-1 000 000	1 000 000	987 042.50	0.47
Fingrid Oyj 3.25% 24-20.03.34	3.250	20.03.34	EUR	-	200 000	-	200 000	196 683.40	0.09
First 1.625% 22-7.04.27 Regs	1.625	07.04.27	EUR	-	200 000	-	200 000	189 880.92	0.09
Fonciere De 4.125% 24-23.05.33	4.125	23.05.33	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	975 864.00	0.46
Fondiaría 5.75% 14-Perp	5.750	31.12.99	EUR	1 400 000	-	-1 400 000	-	-	0.00
France 0.1% 21-25.07.38 /Infl	0.100	25.07.38	EUR	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
France O.A. 0% 21-25.11.31 /Oat	0.000	25.11.31	EUR	-	2 000 000	-	2 000 000	1 596 173.00	0.75
France O.A. 0.75% 21-25.05.53	0.750	25.05.53	EUR	1 000 000	8 500 000	-4 000 000	5 500 000	2 683 234.13	1.26
France O.A. 3% 23-25.06.49 /Oat	3.000	25.06.49	EUR	-	3 000 000	-	3 000 000	2 691 480.00	1.27
Generali FI 4.596% 14-Perp Regs	4.596	31.12.99	EUR	100 000	1 000 000	-1 100 000	-	-	0.00
Germany 0.5% 14-15.04.30 /Infl	0.500	15.04.30	EUR	-	2 000 000	-1 999 000	1 000	1 262.88	0.00
Gn St Nord 0.875% 21-25.11.24	0.875	25.11.24	EUR	750 000	-	-	750 000	736 481.06	0.35
Grenke Fin 5.75% 24-06.07.29	5.750	06.07.29	EUR	-	500 000	-	500 000	506 000.40	0.24
Grenke Fin 7.875% 23-06.04.27	7.875	06.04.27	EUR	-	100 000	-	100 000	107 707.00	0.05
H Lundbeck 0.875% 20-14.10.27	0.875	14.10.27	EUR	200 000	-	-	200 000	181 987.00	0.09

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Euro Broad (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
H&M Fin 4.875% 23-25.10.31	4.875	25.10.31	EUR	-	200 000	-	200 000	209 928.60	0.10
Hbos 4.5% 05-18.03.30	4.500	18.03.30	EUR	-	600 000	-	600 000	598 974.75	0.28
Heineken Nv 3.875% 23-23.09.30	3.875	23.09.30	EUR	100 000	-	-	100 000	102 220.10	0.05
Hellenic 3.375% 24-15.06.34	3.375	15.06.34	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	971 829.77	0.46
Hellenic 4.25% 23-15.06.33	4.250	15.06.33	EUR	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Hera Spa 0.875% 19-05.07.27	0.875	05.07.27	EUR	200 000	-	-	200 000	184 546.25	0.09
Hessen 2.875% 23-04.07.33	2.875	04.07.33	EUR	1 500 000	-	-	1 500 000	1 491 577.50	0.70
Hsbc Hldg 4.752% 10.03.28 Regs	4.752	10.03.28	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Hsbc Hldg 4.787% 10.03.32 Regs	4.787	10.03.32	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Hungary 5.375% 23-12.09.33	5.375	12.09.33	EUR	-	750 000	-464 000	286 000	297 738.50	0.14
Ibb 2.75% 22-04.10.27	2.750	04.10.27	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	991 355.00	0.47
Ibm Corp 0.30% 20-11.02.28	0.300	11.02.28	EUR	500 000	-	-400 000	100 000	89 827.03	0.04
Iccrea Bc 4.25% 24-05.02.30	4.250	05.02.30	EUR	-	500 000	-	500 000	501 674.50	0.24
Iceland 3.5% 24-21.03.34	3.500	21.03.34	EUR	-	600 000	-	600 000	606 429.00	0.29
Ico 1.30% 22-31.10.26	1.300	31.10.26	EUR	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Ico 2.65% 22-31.01.28	2.650	31.01.28	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	981 613.75	0.46
Ico 3.05% 24-30.04.31	3.050	30.04.31	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	991 237.50	0.47
Ing Group 4% 24-12.02.35	4.000	12.02.35	EUR	-	800 000	-500 000	300 000	302 337.87	0.14
Intesa Sanpaolo 2.375% 22.12.30	2.375	22.12.30	EUR	-	700 000	-	700 000	610 033.73	0.29
Investec 0.50% 21-17.02.27	0.500	17.02.27	EUR	600 000	-	-600 000	-	-	0.00
Iren 0.25% 20-17.01.31	0.250	17.01.31	EUR	100 000	-	-	100 000	79 503.65	0.04
Iren 1.95% 18-19.09.25	1.950	19.09.25	EUR	150 000	-	-	150 000	146 796.38	0.07
Isp 3.75% 20-Perp Regs	3.750	31.12.99	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Isp 4.125% 20-Perp	4.125	31.12.99	EUR	-	1 600 000	-1 600 000	-	-	0.00
Isp 4.875% 23-19.05.30 Regs	4.875	19.05.30	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Isp 5.0% 23-08.03.28	5.000	08.03.28	EUR	150 000	-	-150 000	-	-	0.00
Isp 5.625% 23-08.03.33	5.625	08.03.33	EUR	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Italy 0.25% 21-15.03.28 /Btp	0.250	15.03.28	EUR	1 422 000	-	-	1 422 000	1 266 817.14	0.60
Italy 0.50% 20-01.02.26 /Btp	0.500	01.02.26	EUR	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Italy 1.50% 20-30.04.45 /Btp	1.500	30.04.45	EUR	1 000 000	200 000	-	1 200 000	734 268.00	0.35
Italy 2.15% 22-01.09.52 /Btp	2.150	01.09.52	EUR	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Italy 2.8% 16-01.03.67 /Btp	2.800	01.03.67	EUR	-	2 000 000	-	2 000 000	1 406 032.50	0.66
Italy 2.80% 22-15.06.29 /Btp	2.800	15.06.29	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	967 034.36	0.46
Italy 2.95% 17-01.09.38 /Btp	2.950	01.09.38	EUR	-	2 000 000	-	2 000 000	1 721 500.00	0.81
Italy 3.5% 24-15.02.31 /Btp	3.500	15.02.31	EUR	-	2 500 000	-	2 500 000	2 467 474.38	1.16
Italy 4.0% 22-30.04.35 /Btp	4.000	30.04.35	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	995 820.00	0.47
Italy 4.05% 24-30.10.37 /Btp	4.050	30.10.37	EUR	-	2 000 000	-	2 000 000	1 965 923.34	0.93
Italy 4.50% 01.10.53 /Btp 144A	4.500	01.10.53	EUR	1 000 000	-	-500 000	500 000	495 543.75	0.23
Jnj 1.15% 16-20.11.28	1.150	20.11.28	EUR	100 000	-	-	100 000	92 626.33	0.04
John Deere 2.50% 22-14.09.26	2.500	14.09.26	EUR	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Jyske Bk 4.625% 22-11.04.26	4.625	11.04.26	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Jyske Bk 4.875% 23-10.11.29	4.875	10.11.29	EUR	-	100 000	-	100 000	103 328.25	0.05
Jyske Bk 5.125% 24-01.05.35	5.125	01.05.35	EUR	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Jyske Bk 5.50% 16.11.27 Regs	5.500	16.11.27	EUR	200 000	-	-	200 000	207 465.14	0.10
Kbc 1.50% (Frn) 22-29.03.26	1.500	29.03.26	EUR	500 000	-	-	500 000	491 318.75	0.23
Kbc 4.25% 18-Perp	4.250	31.12.99	EUR	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Kbc 4.375% 22-23.11.27 Regs	4.375	23.11.27	EUR	400 000	-	-	400 000	405 222.00	0.19
Kellogg Co 0.50% 21-20.05.29	0.500	20.05.29	EUR	400 000	-	-	400 000	345 995.70	0.16
Kfw 0.01% 19-05.05.27	0.010	05.05.27	EUR	500 000	-	-	500 000	460 625.40	0.22
Kfw 1.375% 22-07.06.32	1.375	07.06.32	EUR	5 000 000	-	-	5 000 000	4 479 322.50	2.11
Kommkrdt 0.75% 18-05.07.28	0.750	05.07.28	EUR	200 000	-	-	200 000	183 701.60	0.09
Kommunalbk 2.75% 22-29.11.27	2.750	29.11.27	EUR	800 000	-	-	800 000	791 310.00	0.37
Kr Hous Fin 4.082% 23-25.09.27	4.082	25.09.27	EUR	-	900 000	-	900 000	919 933.20	0.43
Kvinn Spbk 4.875% 23-24.08.28	4.875	24.08.28	EUR	-	300 000	-	300 000	312 496.11	0.15
Landsbknn 5% 24-13.05.28	5.000	13.05.28	EUR	-	200 000	-	200 000	204 827.40	0.10
Landsbknn 6.375% 12.03.27 Regs	6.375	12.03.27	EUR	-	500 000	-	500 000	525 504.50	0.25
Lbk Hessen Frn 13-03.05.41	4.125	03.05.41	EUR	-	750 000	-	750 000	665 807.55	0.31
Lbk Htg 4.0% 23-04.02.30	4.000	04.02.30	EUR	200 000	-	-	200 000	205 026.92	0.10

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Euro Broad (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Ldkr B-W 0.375% 19-29.07.26	0.375	29.07.26	EUR	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Ldkr B-W 4.0% 19-Perp	4.000	31.12.99	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Liberty Mut 3.625% 19-23.05.59	3.625	23.05.59	EUR	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Liberty Mut 4.625% 22-02.12.30	4.625	02.12.30	EUR	500 000	-	-400 000	100 000	103 110.32	0.05
Lietuvos En 2% 17-14.07.27 Regs	2.000	14.07.27	EUR	100 000	-	-	100 000	94 467.80	0.04
Lithuania 3.5% 24-03.07.31	3.500	03.07.31	EUR	-	1 500 000	-	1 500 000	1 489 455.75	0.70
Lithuania 3.5% 24-13.02.34	3.500	13.02.34	EUR	-	1 200 000	-1 200 000	-	-	0.00
Lloy 4.75% Frn 23-21.09.31 Regs	4.750	21.09.31	EUR	-	100 000	-	100 000	104 344.75	0.05
Lloyds Bk 3.875%(Frn) 14.05.32	3.875	14.05.32	EUR	-	200 000	-	200 000	199 633.90	0.09
Luxemburg 0.0% 20-14.09.32	0.000	14.09.32	EUR	2 000 000	-	-500 000	1 500 000	1 184 290.50	0.56
Lvmh 0.125% 20-11.02.28 Regs	0.125	11.02.28	EUR	200 000	-	-	200 000	179 661.54	0.08
Lvmh 3.25 23-07.09.29 Regs	3.250	07.09.29	EUR	-	200 000	-	200 000	200 262.34	0.09
Madrid 0.42% 21-30.04.31	0.420	30.04.31	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	823 785.75	0.39
Madrid 1.723% 22-30.04.32	1.723	30.04.32	EUR	1 500 000	-	-	1 500 000	1 329 172.50	0.63
Madrid 3.362% 23-31.10.28	3.362	31.10.28	EUR	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Madrid 3.596% 23-30.04.33	3.596	30.04.33	EUR	800 000	-	-	800 000	808 917.60	0.38
Mbank 8.375% 23-11.09.27	8.375	11.09.27	EUR	-	200 000	-	200 000	212 555.50	0.10
Medtrnc 1.375% 20-15.10.40	1.375	15.10.40	EUR	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Met Life 3.625% 24-26.03.34	3.625	26.03.34	EUR	-	200 000	-	200 000	199 486.75	0.09
Morgan Stan 4.656% 23-02.03.29	4.656	02.03.29	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Munhynp 0.01% 21-19.10.39	0.010	19.10.39	EUR	2 400 000	-	-	2 400 000	1 465 068.00	0.69
Munich Re 1.25% 20-26.05.41	1.250	26.05.41	EUR	300 000	-	-	300 000	250 956.47	0.12
Natwest 4.699% 23-14.03.28	4.699	14.03.28	EUR	200 000	-	-	200 000	205 423.14	0.10
Nbn Co Ltd 3.75% 22-03.34 Regs	3.750	22.03.34	EUR	-	750 000	-	750 000	752 408.25	0.35
Ne Prop 2.0% 22-20.01.30	2.000	20.01.30	EUR	-	400 000	-	400 000	348 083.20	0.16
Neste Oil 3.875% 23-16.03.29	3.875	16.03.29	EUR	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Nestle Fin 0.0% 20-03.03.33	0.000	03.03.33	EUR	50 000	-	-	50 000	38 324.69	0.02
Nestle Fin 0.875% 22-29.03.27	0.875	29.03.27	EUR	50 000	-	-50 000	-	-	0.00
Nestle Fin 3.25% 24-23.01.37	3.250	23.01.37	EUR	-	100 000	-	100 000	97 099.05	0.05
Nether Gove 0.5% 19-15.01.40	0.500	15.01.40	EUR	8 250 000	-	-	8 250 000	5 790 010.88	2.73
Nether Gove 0.50% 22-15.07.32	0.500	15.07.32	EUR	2 000 000	-	-	2 000 000	1 681 387.34	0.79
Nether Gove 2.50% 23-15.07.33	2.500	15.07.33	EUR	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Netherlands 3.25% 23-15.01.44	3.250	15.01.44	EUR	-	7 000 000	-	7 000 000	7 313 233.20	3.45
Nn Group 6.0% 23-03.11.43 Regs	6.000	03.11.43	EUR	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Norrd Lbk 4.875% 23-11.07.28	4.875	11.07.28	EUR	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Nordea Bank 4.875% 23-23.02.34	4.875	23.02.34	EUR	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Novo Nord 3.375% 21-05.34 Regs	3.375	21.05.34	EUR	-	500 000	-	500 000	499 033.25	0.24
Novo Nordis 3.375% 24-21.05.26	3.375	21.05.26	EUR	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Nrw Bk 0.0% 20-18.02.30	0.000	18.02.30	EUR	3 000 000	-	-2 500 000	500 000	423 821.63	0.20
Nth Rhine 2.90% 15-01.53 Regs	2.900	15.01.53	EUR	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Nth Rhine-W 0% 19-26.11.29	0.000	26.11.29	EUR	5 045 000	-	-	5 045 000	4 315 102.01	2.03
Nth Rhine-W 0.0% 20-12.10.35	0.000	12.10.35	EUR	3 000 000	-	-	3 000 000	2 130 282.90	1.00
Nth Rhine-W 1.375% 15-01.20 Regs	1.375	15.01.20	EUR	-	1 600 000	-122 000	1 478 000	746 199.41	0.35
Nth Rhine-W 1.45% 22-19.01.22	1.450	19.01.22	EUR	1 000 000	2 000 000	-1 500 000	1 500 000	784 384.88	0.37
Orange 0.125% 20-16.09.29	0.125	16.09.29	EUR	100 000	-	-	100 000	84 805.50	0.04
Orange 0.50% 19-04.09.32	0.500	04.09.32	EUR	100 000	-	-	100 000	79 002.63	0.04
Orange 1.375% 18-20.03.28 Regs	1.375	20.03.28	EUR	100 000	-	-	100 000	93 161.35	0.04
Orange 5.375% 23-Perp Regs	5.375	31.12.99	EUR	200 000	-	-	200 000	207 536.00	0.10
Otp Bank 4.75% 24-12.06.28	4.750	12.06.28	EUR	-	500 000	-	500 000	499 217.50	0.24
Otp Bank 5.50% 22-13.07.25	5.500	13.07.25	EUR	100 000	-	-	100 000	100 022.42	0.05
Otp Bank 6.125% 05-10.27 Regs	6.125	05.10.27	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Otp Bank 7.35% 22-04.03.26	7.350	04.03.26	EUR	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Pandora 3.875% 24-31.05.30	3.875	31.05.30	EUR	-	200 000	-	200 000	199 428.00	0.09
Pandora 4.50% 23-10.04.28	4.500	10.04.28	EUR	100 000	-	-	100 000	102 450.50	0.05
Pepsico 0.875% 19-16.10.39	0.875	16.10.39	EUR	100 000	-	-	100 000	69 490.50	0.03
Pernod Ric 1.375% 07-04.29 Regs	1.375	07.04.29	EUR	300 000	-	-	300 000	272 558.85	0.13
Pko Bank 5.625% 23-01.02.26	5.625	01.02.26	EUR	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Portugal 0.475% 20-18.10.30	0.475	18.10.30	EUR	-	500 000	-	500 000	432 205.00	0.20

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Euro Broad (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Prcrcho 6.0% 16-06.05.26	6.000	06.05.26	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	960 210.00	0.45
Prcrcho 9.5% 24-25.07.34	9.500	25.07.34	EUR	-	1 000 000	-500 000	500 000	514 517.50	0.24
R Bosch Inv 2.625% 13-24.05.28	2.625	24.05.28	EUR	500 000	-	-200 000	300 000	291 741.38	0.14
Raiffeisen 5.15% 24-23.05.30	5.150	23.05.30	EUR	-	500 000	-	500 000	502 751.00	0.24
Raiffeisen 7% 23-12.10.27	7.000	12.10.27	EUR	-	400 000	-	400 000	420 000.00	0.20
Raiffeisen 0.375% 19-25.09.26	0.375	25.09.26	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Raiffeisen 1.5% 19-12.03.30	1.500	12.03.30	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Raiffeisen 4.5% 18-Perp	4.500	31.12.99	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	827 625.00	0.39
Raiffeisen 6% (Frn) 23-15.09.28	6.000	15.09.28	EUR	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Raiffeisen 6.0% 20-Perp	6.000	31.12.99	EUR	200 000	3 000 000	-3 200 000	-	-	0.00
Raiffeisenb 1.0% 21-09.06.28	1.000	09.06.28	EUR	-	600 000	-	600 000	541 754.25	0.26
Raiffeisenb 4.959% 24-05.06.30	4.959	05.06.30	EUR	-	500 000	-	500 000	500 268.10	0.24
Raiffeisenb 7.125% 23-19.01.26	7.125	19.01.26	EUR	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Red Ele Co 4.625% 23-Perp	4.625	31.12.99	EUR	200 000	-	-	200 000	202 770.00	0.10
Red Elec Fi 0.50% 21-24.05.33	0.500	24.05.33	EUR	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Regiao Dos 1.095% 21-27.09.36	1.095	27.09.36	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	719 277.79	0.34
Regiao Dos 3.72% 17.10.28 Regs	3.720	17.10.28	EUR	-	400 000	-	400 000	401 592.00	0.19
Romania 5.0% 22-27.09.26	5.000	27.09.26	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Romania 5.625% 24-22.02.36 Regs	5.625	22.02.36	EUR	-	1 500 000	-	1 500 000	1 464 018.75	0.69
Romania 6.625% 22-27.09.29	6.625	27.09.29	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Sage Grp 3.82% 23-15.02.28 Regs	3.820	15.02.28	EUR	200 000	-	-	200 000	200 851.50	0.09
Sampo Bk 2.50% 20-03.09.52	2.500	03.09.52	EUR	100 000	-	-	100 000	86 337.77	0.04
Sanofi 1.125% 16-05.04.28	1.125	05.04.28	EUR	100 000	-	-	100 000	92 755.59	0.04
Sartorius F 4.5% 14.09.32 Regs	4.500	14.09.32	EUR	-	100 000	-	100 000	102 897.22	0.05
Sartorius F 4.875% 23-14.09.35	4.875	14.09.35	EUR	-	200 000	-	200 000	208 333.10	0.10
Saxony Anth 2.95% 23-20.06.33	2.950	20.06.33	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	999 722.50	0.47
Sbab Bk Ab 4.875% 23-26.06.26	4.875	26.06.26	EUR	-	400 000	-	400 000	403 226.00	0.19
Scentre Mgm 1.45% 19-28.03.29	1.450	28.03.29	EUR	-	500 000	-	500 000	452 330.00	0.21
Seb 0.75% 22-09.08.27	0.750	09.08.27	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Seb 4.125% 23-29.06.27	4.125	29.06.27	EUR	800 000	-	-700 000	100 000	102 180.90	0.05
Seb 5% 23-17.08.33	5.000	17.08.33	EUR	-	333 000	-333 000	-	-	0.00
Shb 0.01% 20-02.12.27	0.010	02.12.27	EUR	-	200 000	-	200 000	178 470.05	0.08
Shb 2.625% 22-05.09.29	2.625	05.09.29	EUR	-	100 000	-	100 000	96 945.93	0.05
Shb 3.75% 22-01.11.27 Regs	3.750	01.11.27	EUR	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Shb 3.75% 24-15.02.34 Regs	3.750	15.02.34	EUR	-	500 000	-400 000	100 000	100 592.05	0.05
Shb 5% 23-16.08.34	5.000	16.08.34	EUR	-	100 000	-100 000	-	-	0.00
Siemens Ene 4.0% 23-05.04.26	4.000	05.04.26	EUR	-	400 000	-	400 000	400 449.00	0.19
Siemens Ene 4.25% 23-05.04.29	4.250	05.04.29	EUR	-	200 000	-	200 000	200 997.34	0.09
Siemens Fin 1.375% 18-06.09.30	1.375	06.09.30	EUR	-	500 000	-	500 000	452 553.00	0.21
Siemens Fin 2.75% 22-09.09.30	2.750	09.09.30	EUR	200 000	-	-	200 000	195 147.50	0.09
Slovenska S 5.375% 23-04.10.28	5.375	04.10.28	EUR	-	100 000	-	100 000	102 798.80	0.05
Smiths Grou 2% 17-23.02.27	2.000	23.02.27	EUR	250 000	-	-	250 000	239 547.50	0.11
Snf Reseau 0.75% 19-25.05.36	0.750	25.05.36	EUR	200 000	-	-	200 000	144 196.05	0.07
Snr 2.375% 22-06.04.28	2.375	06.04.28	EUR	300 000	-	-	300 000	282 994.25	0.13
Socgen 5.625% 23-02.06.33	5.625	02.06.33	EUR	-	400 000	-300 000	100 000	104 272.29	0.05
Socgen 7.875% 23-Perp	7.875	31.12.99	EUR	-	3 100 000	-3 100 000	-	-	0.00
Societe Par 1.125% 18-22.10.28	1.125	22.10.28	EUR	200 000	-	-	200 000	183 233.50	0.09
Sogecap Sa 4.125% /Frn 14-Perp	4.125	31.12.99	EUR	100 000	-	-	100 000	98 629.24	0.05
Sogecap Sa 6.5% 23-16.05.44	6.500	16.05.44	EUR	-	200 000	-	200 000	213 937.00	0.10
Spain 1.45% 19-30.04.29	1.450	30.04.29	EUR	-	3 000 000	-	3 000 000	2 791 965.00	1.32
Spain 4% 24-31.10.54 144A	4.000	31.10.54	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	997 656.25	0.47
Spanish 3.25% 24-30.04.34 144A	3.250	30.04.34	EUR	-	5 000 000	-2 000 000	3 000 000	2 970 877.77	1.40
Spanish Gov 0.0% 21-31.01.28	0.000	31.01.28	EUR	750 000	-	-	750 000	673 827.00	0.32
Spanish Gov 0.85% 21-30.07.37	0.850	30.07.37	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	716 203.00	0.34
Spanish Gov 1.0% 21-30.07.42	1.000	30.07.42	EUR	500 000	500 000	-	1 000 000	640 915.00	0.30
Spanish Gov 1.90% 22-31.10.52	1.900	31.10.52	EUR	-	1 500 000	-	1 500 000	984 900.00	0.46
Spanish Gov 3.55% 23-31.10.33	3.550	31.10.33	EUR	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Sparebank 1 3.625% 24-30.05.29	3.625	30.05.29	EUR	-	700 000	-	700 000	701 713.25	0.33

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Euro Broad (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Spbk Bolikr 0.5% 18-30.01.25	0.500	30.01.25	EUR	200 000	-	-	200 000	196 572.25	0.09
Sse 0.875% 17-06.09.25 Regs	0.875	06.09.25	EUR	200 000	-	-	200 000	193 748.40	0.09
Sse 2.875% 22-01.08.29 Regs	2.875	01.08.29	EUR	150 000	-	-	150 000	145 133.10	0.07
St Gobain 3.375% 24-08.04.30	3.375	08.04.30	EUR	-	100 000	-	100 000	98 744.10	0.05
Statnett Sf 3.375% 24-26.02.36	3.375	26.02.36	EUR	-	900 000	-	900 000	878 200.20	0.41
Stedin Hold 2.375% 03.06.30 Regs	2.375	03.06.30	EUR	-	200 000	-	200 000	187 934.90	0.09
Stif 3.45% 24-25.06.49	3.450	25.06.49	EUR	-	100 000	-	100 000	93 101.32	0.04
Svensk Expo 2.0% 22-30.06.27	2.000	30.06.27	EUR	1 500 000	-	-	1 500 000	1 449 177.75	0.68
Swedbank 4.375% 23-05.09.30	4.375	05.09.30	EUR	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Sydbank 4.125% 24-30.09.27 Regs	4.125	30.09.27	EUR	-	200 000	-	200 000	200 941.10	0.09
Sydbank 4.75% 22-30.09.25	4.750	30.09.25	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Sydbank 5.125% 23-06.09.28	5.125	06.09.28	EUR	-	250 000	-250 000	-	-	0.00
Tdc Net 5.186% 24-02.08.29 Regs	5.186	02.08.29	EUR	-	100 000	-	100 000	101 629.05	0.05
Telefonica 1.201% 20-21.08.27	1.201	21.08.27	EUR	100 000	-	-	100 000	93 392.10	0.04
Telefonica 1.807% 20-21.05.32	1.807	21.05.32	EUR	100 000	-	-	100 000	87 484.23	0.04
Tissee 4% 24-08.04.39	4.000	08.04.39	EUR	-	3 000 000	-	3 000 000	2 895 405.00	1.36
Tor Dom 1.952% 22-08.04.30 B Regs	1.952	08.04.30	EUR	550 000	-	-450 000	100 000	90 788.50	0.04
Ubs Group F 0.25% 21-03.11.26	0.250	03.11.26	EUR	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Ubs Group F 4.75% 23-17.03.32	4.750	17.03.32	EUR	100 000	200 000	-300 000	-	-	0.00
Unibail Rod 4.125% 23-11.12.30	4.125	11.12.30	EUR	-	500 000	-	500 000	502 034.50	0.24
Unibail Rod 7.25% 23-Perp	7.250	31.12.99	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Unilev Cap 3.40% 23-06.06.33	3.400	06.06.33	EUR	100 000	-	-	100 000	99 975.75	0.05
Unilever 1.375% 18-04.09.30	1.375	04.09.30	EUR	200 000	-	-	200 000	179 843.75	0.08
United Util 3.75% 24-23.05.34 Regs	3.750	23.05.34	EUR	-	400 000	-	400 000	388 636.00	0.18
Valmet Corp 4% 24-13.03.29	4.000	13.03.29	EUR	-	400 000	-	400 000	399 063.60	0.19
Van Lansch Kemp 8.875% 24-Perp	8.875	31.12.99	EUR	-	800 000	-	800 000	860 250.00	0.41
Verizon Com 0.75% 21-22.03.32	0.750	22.03.32	EUR	100 000	-	-	100 000	81 195.00	0.04
Verizon Com 1.375% 16-02.11.28	1.375	02.11.28	EUR	100 000	-	-	100 000	92 126.73	0.04
Vivat Nv 7% 18-Perp Regs	7.000	31.12.99	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Vodafone In 3.25% 22-02.03.29	3.250	02.03.29	EUR	150 000	-	-	150 000	149 017.77	0.07
Vodafone In 3.75% 22-02.12.34	3.750	02.12.34	EUR	200 000	-	-	200 000	199 921.34	0.09
Volksbank 4.75% 23-15.03.27	4.750	15.03.27	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Volksbank 7.75% 19-Perp	7.750	31.12.99	EUR	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Wienerber 4.875% 04.10.28 Regs	4.875	04.10.28	EUR	-	400 000	-	400 000	416 357.88	0.20
Zuercher Kb 0.0% 21-15.05.26	0.000	15.05.26	EUR	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
							180 818 980.48	85.22	

Indexoptionen

Euro Bund	25.08.23	EUR	-	150	-150	-	-	0.00
Euro Bund	25.08.23	EUR	-	150	-150	-	-	0.00
Euro Bund	25.08.23	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Euro Bund	21.06.24	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Euro Bund	26.07.24	EUR	-	50	-50	-	-	0.00
Euro Bund	26.07.24	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Euro Bund	22.09.23	EUR	-	250	-250	-	-	0.00
Euro Bund	22.09.23	EUR	-	350	-350	-	-	0.00
Euro Bund	27.10.23	EUR	-	300	-300	-	-	0.00
Euro Bund	27.10.23	EUR	-	150	-150	-	-	0.00
Euro Bund	27.10.23	EUR	-	150	-150	-	-	0.00
Euro Bund	27.10.23	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Euro Bund	24.11.23	EUR	-	275	-275	-	-	0.00
Euro Bund	22.12.23	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Euro Bund	22.12.23	EUR	-	100	-100	-	-	0.00
Euro Bund	22.12.23	EUR	-	150	-150	-	-	0.00
Euro Bund	24.05.24	EUR	-	150	-150	-	-	0.00
Euro Bund	24.05.24	EUR	-	150	-150	-	-	0.00
Euro Bund	26.04.24	EUR	-	200	-200	-	-	0.00
Euro Bund	26.04.24	EUR	-	100	-100	-	-	0.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Euro Broad (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Euro Bund		24.05.24	EUR	-	150	-150	-	-	0.00
Euro Bund		24.05.24	EUR	-	150	-150	-	-	0.00
Euro Bund		24.05.24	EUR	-	150	-150	-	-	0.00
Euro Bund		24.05.24	EUR	-	150	-150	-	-	0.00
									0.00

Schatzwechsel

Deutschland 0% 22-19.07.23 Tb		19.07.23	EUR	100	-	-100	-	-	0.00
Deutschland 0% 23-13.12.23 Tb		13.12.23	EUR	100	3 000 000	-3 000 100	-	-	0.00
Deutschland 0% 23-15.05.24 Tb		15.05.24	EUR	100	2 000 000	-2 000 100	-	-	0.00
Deutschland 0% 23-16.10.24 Tb		16.10.24	EUR	-	2 000 100	-	2 000 100	1 980 356.75	0.93
Deutschland 0% 23-17.01.24 Tb		17.01.24	EUR	100	2 000 000	-2 000 100	-	-	0.00
Deutschland 0% 23-17.07.24 Tb		17.07.24	EUR	-	2 000 100	-	2 000 100	1 997 161.67	0.94
Deutschland 0% 23-18.09.24 Tb		18.09.24	EUR	-	2 000 100	-	2 000 100	1 985 541.97	0.94
Deutschland 0% 23-19.06.24 Tb		19.06.24	EUR	100	2 000 000	-2 000 100	-	-	0.00
Deutschland 0% 23-20.03.24 Tb		20.03.24	EUR	100	2 000 000	-2 000 100	-	-	0.00
Deutschland 0% 23-20.11.24 Tb		20.11.24	EUR	-	4 000 200	-2 000 100	2 000 100	1 973 574.93	0.93
Deutschland 0% 23-21.02.24 Tb		21.02.24	EUR	100	2 000 000	-2 000 100	-	-	0.00
Deutschland 0% 24-11.12.24 Tb		11.12.24	EUR	-	2 000 100	-	2 000 100	1 970 185.82	0.93
Deutschland 0% 24-15.01.25 Tb		15.01.25	EUR	-	2 000 100	-	2 000 100	1 964 003.72	0.93
Deutschland 0% 24-19.02.25 Tb		19.02.25	EUR	-	2 000 100	-	2 000 100	1 958 221.45	0.92
Germany 0% 23-21.08.24 Tb		21.08.24	EUR	-	2 000 100	-	2 000 100	1 990 527.04	0.94
Germany 0% 24-19.03.25 Tb		19.03.25	EUR	-	2 000 100	-	2 000 100	1 953 635.48	0.92
								17 773 208.83	8.38

Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind **198 592 189.31** **93.60**

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Anleihen

Autostrade 5.125% 14.06.33 Regs	5.125	14.06.33	EUR	200 000	-	-	200 000	207 981.60	0.10
Banca Ifis 6.125% 23-19.01.27	6.125	19.01.27	EUR	150 000	-	-150 000	-	-	0.00
Bpce 4.125% 23-10.07.28	4.125	10.07.28	EUR	200 000	-	-	200 000	204 077.10	0.09
Cassa Depo 4.75% 18.10.30 Regs	4.750	18.10.30	EUR	-	3 300 000	-	3 300 000	3 414 142.71	1.61
Jfm 0.05% 20-12.02.27	0.050	12.02.27	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	919 197.50	0.43
Kommuninv 3.125% 23-08.12.27	3.125	08.12.27	EUR	-	100 000	-100 000	-	-	0.00
Ldkr B-W 0.25% 21-21.07.28	0.250	21.07.28	EUR	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Munhynp 7.125% 23-31.10.28 Regs	7.125	31.10.28	EUR	-	300 000	-300 000	-	-	0.00
Orsted 5.25% 22-08.12.22	5.250	08.12.22	EUR	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Socgen 4.25% 22-06.12.30	4.250	06.12.30	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Spain 0% 17-30.07.48 /Stp Io	0.000	30.07.48	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Tatra Banka 4.971% 24-29.04.30	4.971	29.04.30	EUR	-	400 000	-	400 000	404 606.00	0.19
Telefonica 6.75% 23-Perp	6.750	31.12.99	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Unipol 3.25% 20-23.09.30	3.250	23.09.30	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	996 614.00	0.47
Vr-Group PI 2.375% 22-30.05.29	2.375	30.05.29	EUR	800 000	-	-	800 000	757 096.92	0.36
								6 903 715.83	3.25

Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere **6 903 715.83** **3.25**

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Euro Broad (Fortsetzung)

	01.07.2023		Schlussbestand 30.06.2024		EUR	
Sonstige übertragbare Wertpapiere						
Anleihen						
East J 3.976% 23-05.09.32 Regs	3.976	05.09.32	EUR	-	400 000	- 400 000
						413 651.00 0.20
						413 651.00 0.20
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere						413 651.00 0.20
SUMME WERTPAPIERBESTAND						205 909 556.14 97.05
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen						3 128 207.99 1.47
Sonstige Aktiven						3 126 553.41 1.48
GESAMTNETTOVERMÖGEN						212 164 317.54 100.00

JSS Sustainable Bond - EUR Corporates

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Anleihen									
A2A 0.625% 21-15.07.31	0.625	15.07.31	EUR	800 000	-	-	800 000	640 534.00	0.59
Aareal Bk 4.50% 22-25.07.25	4.500	25.07.25	EUR	300 000	-	-	300 000	301 823.40	0.28
Aareal Bk 5.875% 24-29.05.26	5.875	29.05.26	EUR	-	400 000	-	400 000	404 707.00	0.38
Ab Inbev 2% 18-23.01.35	2.000	23.01.35	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	866 575.00	0.80
Abanca Co 5.875% (Frn) 02.04.30	5.875	02.04.30	EUR	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Abb Fin Bv 3.125% 24-15.01.29	3.125	15.01.29	EUR	-	400 000	-	400 000	397 341.60	0.37
Abb Fin Bv 3.375% 23-16.01.31	3.375	16.01.31	EUR	400 000	-	-	400 000	400 514.68	0.37
Abbott II F 0.375% 19-19.11.27	0.375	19.11.27	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Abertis	1.375	20.05.26	EUR	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Abertis 1.25% 20-07.02.28	1.250	07.02.28	EUR	100 000	-	-	100 000	91 674.75	0.09
Acciona Ene 5.125% 23-23.04.31	5.125	23.04.31	EUR	-	400 000	-	400 000	414 126.48	0.38
Accor 1.75% 19-04.02.26	1.750	04.02.26	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Achmea Bv 4.25% 15-Perp	4.250	31.12.99	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Adidas 3.125% 22-21.11.29 Regs	3.125	21.11.29	EUR	200 000	-	-	200 000	199 241.07	0.19
Aegon 4% 14-25.04.44	4.000	25.04.44	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Ageas Fin 3.875% 19-Perp Regs	3.875	31.12.99	EUR	-	600 000	-	600 000	511 014.12	0.47
Air Liquide 0.375% 21-27.05.31	0.375	27.05.31	EUR	200 000	-	-	200 000	163 933.10	0.15
Akzo Nobel 1.625% 20-14.04.30	1.625	14.04.30	EUR	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Ald Sa 4% 24-24.01.31	4.000	24.01.31	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Alpha Bank 6.875% 23-27.06.29	6.875	27.06.29	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Amp Tech Hd 0.75% 20-04.05.26	0.750	04.05.26	EUR	500 000	-	-	500 000	475 671.50	0.44
Amp Tech Hd 2% 18-08.10.28	2.000	08.10.28	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Apple Inc 0.50% 19-15.11.31	0.500	15.11.31	EUR	500 000	-	-	500 000	417 389.63	0.39
Apple Inc 1.375% 17-24.05.29	1.375	24.05.29	EUR	700 000	-	-	700 000	648 786.25	0.60
Apt Pipelin 2.0% 20-15.07.30	2.000	15.07.30	EUR	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Aroundtown 1.625% 21-Perp	1.625	31.12.99	EUR	1 300 000	-	-1 300 000	-	-	0.00
Asr 3.625% 23-12.12.28	3.625	12.12.28	EUR	-	100 000	-	100 000	100 156.75	0.09
Athora Hold 6.625% 23-16.06.28	6.625	16.06.28	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	1 057 352.50	0.98
Atradius Fi 5.25% 14-23.09.44	5.250	23.09.44	EUR	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Banco Bpm 4.875% 24-17.01.30	4.875	17.01.30	EUR	-	400 000	-	400 000	409 392.00	0.38
Bank Pekao 5.5% 23-23.11.27	5.500	23.11.27	EUR	-	500 000	-	500 000	510 466.25	0.47
Bankinter 4.875% 23-13.09.31	4.875	13.09.31	EUR	-	500 000	-	500 000	523 148.25	0.49
Barry Calbt 4% 24-14.06.29	4.000	14.06.29	EUR	-	600 000	-	600 000	602 022.00	0.56
Bbva 0.50% 20-14.01.27	0.500	14.01.27	EUR	700 000	-	-	700 000	648 124.75	0.60
Bbva 3.875% 24-15.01.34	3.875	15.01.34	EUR	-	500 000	-	500 000	503 158.85	0.47
Bco Sab 4% 24-15.01.30	4.000	15.01.30	EUR	-	100 000	-	100 000	100 974.16	0.09
Bco Sab 4.25% 24-13.09.30	4.250	13.09.30	EUR	-	100 000	-	100 000	101 015.10	0.09
Bco Sab 5.125% 22-10.11.28	5.125	10.11.28	EUR	200 000	-	-	200 000	208 645.54	0.19
Bco Sab 6.00% 23-16.08.33 Regs	6.000	16.08.33	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Bcp 5.625% 23-02.10.26 Regs	5.625	02.10.26	EUR	-	400 000	-	400 000	407 678.00	0.38
Bcp 8.75% 22-05.03.33	8.750	05.03.33	EUR	-	500 000	-	500 000	558 123.75	0.52
Belfius Bk 3.75% 24-22.01.29	3.750	22.01.29	EUR	-	200 000	-	200 000	200 012.70	0.19
Belfius Bk 3.875% 23-12.06.28	3.875	12.06.28	EUR	400 000	-	-	400 000	405 905.48	0.38
Belfius Bk 4.125% 23-12.09.29	4.125	12.09.29	EUR	-	400 000	-	400 000	409 549.28	0.38
Bfcm 0.01% 21-07.03.25	0.010	07.03.25	EUR	100 000	-	-	100 000	97 516.00	0.09
Bfcm 2.625% 22-06.11.29	2.625	06.11.29	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	940 976.25	0.87
Bfcm 3.5% 24-15.05.31	3.500	15.05.31	EUR	-	200 000	-	200 000	197 741.50	0.18
Bfcm 3.75% 22-01.02.33	3.750	01.02.33	EUR	300 000	-	-	300 000	299 920.13	0.28
Bfcm 4.125% 23-18.09.30	4.125	18.09.30	EUR	-	100 000	-	100 000	102 765.35	0.10
Bmw Fin 3.25% 23-22.07.30	3.250	22.07.30	EUR	800 000	-	-	800 000	802 674.00	0.75
Bnp Par 4.125% 23-26.09.32 Regs	4.125	26.09.32	EUR	-	600 000	-	600 000	614 655.00	0.57
Bnp Par 4.75% 23-13.11.32	4.750	13.11.32	EUR	-	600 000	-	600 000	626 678.22	0.58
Bpce 1% 19-01.04.25	1.000	01.04.25	EUR	600 000	-	-	600 000	587 773.80	0.55

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - EUR Corporates (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Bpce 3.875% 24-25.01.36 Regs	3.875	25.01.36	EUR	-	100 000	-	100 000	99 472.90	0.09
Bpce 4.875% 24-26.02.36 Regs	4.875	26.02.36	EUR	-	200 000	-	200 000	202 053.50	0.19
Bpce Sfh 3.125% 24-22.05.34	3.125	22.05.34	EUR	-	100 000	-	100 000	99 114.70	0.09
Bqe Postale 0.75% 21-02.08.32	0.750	02.08.32	EUR	400 000	-	-	400 000	357 282.40	0.33
Brenntag 0.50% 21-06.10.29	0.500	06.10.29	EUR	100 000	-	-	100 000	85 081.20	0.08
Brisa C Rod 2.375% 17-10.05.27	2.375	10.05.27	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Britel 1.5% 17-23.06.27	1.500	23.06.27	EUR	500 000	-	-	500 000	472 398.50	0.44
By Lbk 1.0% 21-23.09.31	1.000	23.09.31	EUR	600 000	-	-600 000	-	-	0.00
By Lbk 1.375% 21-22.11.32	1.375	22.11.32	EUR	-	700 000	-700 000	-	-	0.00
By Lbk 2.875% 24-15.07.30 Regs	2.875	15.07.30	EUR	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
By Lbk 3.75% 23-07.02.29	3.750	07.02.29	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
By Lbk 4.25% 23-21.06.27	4.250	21.06.27	EUR	500 000	-	-	500 000	509 171.25	0.47
Caixabank 5% 23-19.07.29	5.000	19.07.29	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Caixabank 6.125% (Frn) 23-30.05.34	6.125	30.05.34	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Castellum 0.75% 19-04.09.26	0.750	04.09.26	EUR	400 000	-	-	400 000	373 183.80	0.35
Castellum 2.125% 18-20.11.23 Regs	2.125	20.11.23	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Cattol Ass 4.25% 17-14.12.47	4.250	14.12.47	EUR	300 000	-	-	300 000	298 456.73	0.28
Ceska Spo 4.824% 15.01.30 Regs	4.824	15.01.30	EUR	-	200 000	-	200 000	203 248.24	0.19
Ceska Spo 5.737% 23-08.03.28	5.737	08.03.28	EUR	-	200 000	-	200 000	206 679.50	0.19
Cfcm 4.125% 23-02.04.31	4.125	02.04.31	EUR	-	200 000	-	200 000	204 213.30	0.19
Cnp Ass. Frn 05-Perp.	3.593	31.12.99	EUR	-	300 000	-	300 000	282 300.00	0.26
Cnp Assuran 1.25% 27.01.29 Regs	1.250	27.01.29	EUR	100 000	-	-	100 000	88 584.85	0.08
Coca Cola 0.375% 20-15.03.33	0.375	15.03.33	EUR	100 000	-	-	100 000	78 347.71	0.07
Coca-Cola 3.375% 24-27.02.28	3.375	27.02.28	EUR	-	500 000	-	500 000	497 678.75	0.46
Comcast 0.0% 21-14.09.26	0.000	14.09.26	EUR	200 000	-	-	200 000	185 672.00	0.17
Comcast 0.25% 20-20.05.27	0.250	20.05.27	EUR	500 000	-	-	500 000	458 017.00	0.43
Comcast 0.75% 20-20.02.32	0.750	20.02.32	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Comwith Ny 4.266% 24-04.06.34	4.266	04.06.34	EUR	-	500 000	-	500 000	501 402.50	0.47
Continental 3.625% 22-30.11.27	3.625	30.11.27	EUR	200 000	-	-	200 000	201 031.20	0.19
Covivio Sa 4.625% 23-05.06.32	4.625	05.06.32	EUR	-	500 000	-	500 000	508 308.10	0.47
Cred Agric 4.125% 07.03.30 Regs	4.125	07.03.30	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Credem It 4.875% 23-26.03.30	4.875	26.03.30	EUR	-	500 000	-	500 000	520 289.25	0.48
De Volksban 1.75% 20-22.10.30	1.750	22.10.30	EUR	-	200 000	-	200 000	192 824.40	0.18
Dell Bank 0.50% 27.10.26 Regs	0.500	27.10.26	EUR	500 000	-	-	500 000	466 386.50	0.43
Delta Lloyd	4.375	31.12.99	EUR	151 000	-	-151 000	-	-	0.00
Deut Kredbk 0.75% 17-26.09.24	0.750	26.09.24	EUR	200 000	-	-	200 000	198 349.55	0.18
Deut Tel 1.375% 19-05.07.34 Regs	1.375	05.07.34	EUR	200 000	-	-	200 000	169 213.60	0.16
Deutsch 1.375% 18-28.03.31 Regs	1.375	28.03.31	EUR	2 000 000	-	-	2 000 000	1 792 362.40	1.66
Diageo Cap 0.125% 20-28.09.28	0.125	28.09.28	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	878 399.20	0.82
Dnb Bank As 4.5% 19.07.28 Regs	4.500	19.07.28	EUR	-	500 000	-	500 000	512 301.85	0.48
Dnb Bank As 4.625% 23-01.11.29	4.625	01.11.29	EUR	-	200 000	-	200 000	207 491.72	0.19
Ds Smith 0.875% 12.09.26 Regs	0.875	12.09.26	EUR	400 000	-	-	400 000	376 664.40	0.35
Dt Bahn Fin 0.625% 20-08.12.50	0.625	08.12.50	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	502 692.00	0.47
Dtch Wohnen 1.0% 20-30.04.25	1.000	30.04.25	EUR	600 000	-	-	600 000	585 031.20	0.54
E.On 0.375% 20-29.09.27	0.375	29.09.27	EUR	100 000	-	-	100 000	91 199.75	0.08
E.On 1.625% 22-29.03.31	1.625	29.03.31	EUR	1 500 000	-	-500 000	1 000 000	890 877.50	0.83
East Japan 4.389% 23-05.09.43	4.389	05.09.43	EUR	-	500 000	-	500 000	519 092.50	0.48
East Japan 0.773% 15.09.34 Regs	0.773	15.09.34	EUR	600 000	-	-	600 000	463 404.30	0.43
Edp 3.875% 23-26.06.28	3.875	26.06.28	EUR	100 000	-	-	100 000	100 875.30	0.09
Eli Lilly 0.625% 19-01.11.31	0.625	01.11.31	EUR	300 000	-	-	300 000	249 779.57	0.23
Elia Group 5.85% 23-Perp	5.850	31.12.99	EUR	100 000	-	-	100 000	103 240.62	0.10
Elisa Corp 4% 23-27.01.29	4.000	27.01.29	EUR	-	600 000	-	600 000	610 290.00	0.57
Elm Bv 3.375% 17-29.09.47 Regs	3.375	29.09.47	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Elo 6% 23-22.03.29	6.000	22.03.29	EUR	-	600 000	-600 000	-	-	0.00
Emerson El 1.25% 19-15.10.25	1.250	15.10.25	EUR	700 000	-	-	700 000	679 132.30	0.63
Enel Fin 3.875% 24-23.01.35	3.875	23.01.35	EUR	-	200 000	-	200 000	196 277.75	0.18
Enexis 3.625% 23-12.06.34	3.625	12.06.34	EUR	200 000	-	-	200 000	203 194.30	0.19
Epiroc 3.625% 24-28.02.31 Regs	3.625	28.02.31	EUR	-	100 000	-	100 000	98 950.40	0.09

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - EUR Corporates (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Eqt 2.875% 22-06.04.32	2.875	06.04.32	EUR	750 000	-	-	750 000	679 434.75	0.63
Ericsson 1.125% 22-08.02.27	1.125	08.02.27	EUR	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Ericsson 5.375% 23-29.05.28	5.375	29.05.28	EUR	-	300 000	-	300 000	314 109.66	0.29
Erste Bk 0.10% 20-16.11.28	0.100	16.11.28	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	894 346.00	0.83
Erste Bk 4.0% 23-16.01.31	4.000	16.01.31	EUR	600 000	-	-600 000	-	-	0.00
Erste Bk 4.25% 20-Perp	4.250	31.12.99	EUR	-	600 000	-	600 000	543 000.00	0.50
Erste Bk 4.25% 23-30.05.30	4.250	30.05.30	EUR	-	600 000	-	600 000	616 900.92	0.57
Eurbnk 5.875% (Frn) 28.11.29 Regs	5.875	28.11.29	EUR	-	300 000	-	300 000	316 470.00	0.29
Eurofins 3.75% 20-17.07.26	3.750	17.07.26	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Eurogrid 3.279% 22-05.09.31	3.279	05.09.31	EUR	200 000	-	-	200 000	194 597.30	0.18
Eurogrid 3.915% 24-01.02.34	3.915	01.02.34	EUR	-	300 000	-	300 000	299 354.25	0.28
Fastighets 1.25% 20-28.01.28	1.250	28.01.28	EUR	600 000	-	-600 000	-	-	0.00
Fonciere De 4.125% 24-23.05.33	4.125	23.05.33	EUR	-	400 000	-	400 000	390 345.60	0.36
Fondiaria	5.750	31.12.99	EUR	1 600 000	-	-1 600 000	-	-	0.00
France 2.5% 24.09.26/ Oat Regs	2.500	24.09.26	EUR	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Generali Fi 4.596% 14-Perp Regs	4.596	31.12.99	EUR	400 000	-	-	400 000	399 651.40	0.37
Glbwr Re Es 3% 18-29.03.25 Regs	3.000	29.03.25	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Gn St Nord 0.875% 21-25.11.24	0.875	25.11.24	EUR	1 500 000	-	-	1 500 000	1 472 962.13	1.37
Grenke Fin 5.75% 24-06.07.29	5.750	06.07.29	EUR	-	500 000	-	500 000	506 000.40	0.47
Grenke Fin 7.875% 23-06.04.27	7.875	06.04.27	EUR	-	100 000	-	100 000	107 707.00	0.10
H Lundbeck 0.875% 20-14.10.27	0.875	14.10.27	EUR	200 000	-	-	200 000	181 987.00	0.17
H&M Fin 4.875% 23-25.10.31	4.875	25.10.31	EUR	-	200 000	-	200 000	209 928.60	0.19
Hbos 4.5% 05-18.03.30	4.500	18.03.30	EUR	-	600 000	-	600 000	598 974.75	0.56
Heineken Nv 3.875% 23-23.09.30	3.875	23.09.30	EUR	100 000	-	-	100 000	102 220.10	0.09
Hld Inf Tr 2.5% 20-04.05.27	2.500	04.05.27	EUR	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Hld Inf Tra 1.625% 20-18.09.29	1.625	18.09.29	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Hsbc Hldg 4.752% 10.03.28 Regs	4.752	10.03.28	EUR	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Hsbc Hldg 4.787% 10.03.32 Regs	4.787	10.03.32	EUR	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Iberdrola I 2.625% 18-Perp	2.625	31.12.99	EUR	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Ibm Corp 0.30% 20-11.02.28	0.300	11.02.28	EUR	500 000	-	-100 000	400 000	359 308.10	0.33
Imerys 1.0% 21-15.07.31	1.000	15.07.31	EUR	500 000	-	-	500 000	402 785.50	0.37
In Justitia 9.25% 22-15.03.28	9.250	15.03.28	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Ing Groep 1.125% 18-14.02.25	1.125	14.02.25	EUR	-	700 000	-	700 000	688 704.10	0.64
Ing Group 4% 24-12.02.35	4.000	12.02.35	EUR	-	500 000	-	500 000	503 896.45	0.47
Investec 0.50% 21-17.02.27	0.500	17.02.27	EUR	1 200 000	-	-700 000	500 000	471 817.50	0.44
Iren 0.875% 19-14.10.29 Regs	0.875	14.10.29	EUR	300 000	-	-	300 000	259 568.55	0.24
Isp 5.0% 23-08.03.28	5.000	08.03.28	EUR	300 000	-	-	300 000	308 890.50	0.29
Isp 5.625% 23-08.03.33	5.625	08.03.33	EUR	500 000	-	-	500 000	547 554.25	0.51
Italy 0.0% 21-15.12.24 /Btp	0.000	15.12.24	EUR	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Italy 3.6% 23-29.09.25 /Btp	3.600	29.09.25	EUR	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Itv 1.375% 19-26.09.26	1.375	26.09.26	EUR	400 000	-	-300 000	100 000	95 156.90	0.09
Jnj 1.15% 16-20.11.28	1.150	20.11.28	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	926 263.25	0.86
Jnj 3.35% 24-01.06.36	3.350	01.06.36	EUR	-	200 000	-	200 000	199 178.55	0.19
John Deere 1.375% 20-02.04.24	1.375	02.04.24	EUR	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
John Deere 2.50% 22-14.09.26	2.500	14.09.26	EUR	200 000	-	-	200 000	196 248.05	0.18
Jyske Bk 4.625% 22-11.04.26	4.625	11.04.26	EUR	500 000	-	-	500 000	502 389.00	0.47
Jyske Bk 4.875% 23-10.11.29	4.875	10.11.29	EUR	-	300 000	-	300 000	309 984.75	0.29
Jyske Bk 5.50% 16.11.27 Regs	5.500	16.11.27	EUR	500 000	-	-	500 000	518 662.85	0.48
Kbc 1.50% (Frn) 22-29.03.26	1.500	29.03.26	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	982 637.50	0.91
Kbc 4.25% 18-Perp	4.250	31.12.99	EUR	-	600 000	-	600 000	582 550.50	0.54
Kbc 4.375% 22-23.11.27 Regs	4.375	23.11.27	EUR	500 000	-	-	500 000	506 527.50	0.47
Kellogg Co 0.50% 21-20.05.29	0.500	20.05.29	EUR	400 000	-	-	400 000	345 995.70	0.32
Klepierre 1.375% 17-16.02.27	1.375	16.02.27	EUR	100 000	-	-	100 000	94 793.13	0.09
Kpn 0.875% 20-14.12.32 Regs	0.875	14.12.32	EUR	200 000	-	-	200 000	160 600.65	0.15
Kvinn Spbk 4.875% 23-24.08.28	4.875	24.08.28	EUR	-	300 000	-	300 000	312 496.11	0.29
Landsbknn 5% 24-13.05.28	5.000	13.05.28	EUR	-	100 000	-	100 000	102 413.70	0.10
Landsbknn 6.375% 12.03.27 Regs	6.375	12.03.27	EUR	-	200 000	-	200 000	210 201.80	0.20
Lbk Bw 3.625% 15-16.06.25	3.625	16.06.25	EUR	500 000	-	-	500 000	498 421.00	0.46

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - EUR Corporates (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Lbk Htg 4.0% 23-04.02.30	4.000	04.02.30	EUR	200 000	-	-	200 000	205 026.92	0.19
Ldkr B-W 0.375% 29.07.26 Regs	0.375	29.07.26	EUR	200 000	-	-	200 000	185 801.87	0.17
Ldkr B-W 4.0% 19-Perp	4.000	31.12.99	EUR	600 000	-	-600 000	-	-	0.00
Leg Immo 0.75% 21-30.06.31	0.750	30.06.31	EUR	100 000	-	-	100 000	79 778.05	0.07
Liberty Mut 3.625% 19-23.05.59	3.625	23.05.59	EUR	-	600 000	-600 000	-	-	0.00
Liberty Mut 4.625% 22-02.12.30	4.625	02.12.30	EUR	500 000	-	-	500 000	515 551.60	0.48
Linde Fin 0.55% 20-19.05.32	0.550	19.05.32	EUR	200 000	-	-	200 000	161 886.25	0.15
Lloyds Bk 3.875%(Frn) 14.05.32	3.875	14.05.32	EUR	-	200 000	-	200 000	199 633.90	0.19
Lvmh 0.125% 20-11.02.28 Regs	0.125	11.02.28	EUR	400 000	-	-	400 000	359 323.08	0.33
Lvmh 3.25 23-07.09.29 Regs	3.250	07.09.29	EUR	-	400 000	-	400 000	400 524.68	0.37
Macquarie G 0.95% 21-21.05.31	0.950	21.05.31	EUR	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Madrilena R 1.375% 17-11.04.25	1.375	11.04.25	EUR	600 000	-	-	600 000	588 748.08	0.55
Madrilena R 2.25% 17-11.04.29	2.250	11.04.29	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Manpower 1.75% 18-22.06.26	1.750	22.06.26	EUR	500 000	-	-	500 000	484 248.75	0.45
Mbank 8.375% 23-11.09.27	8.375	11.09.27	EUR	-	300 000	-	300 000	318 833.25	0.30
Medtrnc 1.125% 19-07.03.27	1.125	07.03.27	EUR	900 000	-	-900 000	-	-	0.00
Medtrnc 1.375% 20-15.10.40	1.375	15.10.40	EUR	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Met Life 3.625% 24-26.03.34	3.625	26.03.34	EUR	-	300 000	-	300 000	299 230.13	0.28
Met Life 3.75% 23-07.12.31 Regs	3.750	07.12.31	EUR	-	250 000	-	250 000	254 803.75	0.24
Metsa Board 2.75% 17-29.09.27	2.750	29.09.27	EUR	700 000	-	-	700 000	677 806.50	0.63
Morgan Stan 4.656% 23-02.03.29	4.656	02.03.29	EUR	600 000	100 000	-600 000	100 000	103 167.23	0.10
Munhvp 3% 24-01.02.34	3.000	01.02.34	EUR	-	100 000	-	100 000	99 274.50	0.09
Munich Re 1.25% 20-26.05.41	1.250	26.05.41	EUR	500 000	-	-	500 000	418 260.78	0.39
Munich Re 4.25% 24-26.05.44	4.250	26.05.44	EUR	-	500 000	-	500 000	492 788.00	0.46
Nat Bui Soc 1.5% 18-08.03.26	1.500	08.03.26	EUR	700 000	-	-	700 000	688 767.10	0.64
Nat Bui Soc 4.375% 24-16.04.34	4.375	16.04.34	EUR	-	200 000	-	200 000	199 713.44	0.19
Natwest 4.699% 23-14.03.28	4.699	14.03.28	EUR	400 000	-	-	400 000	410 846.28	0.38
Neste Oil 3.875% 23-16.03.29	3.875	16.03.29	EUR	200 000	-	-	200 000	201 896.50	0.19
Neste Oil 4.25% 23-16.03.33	4.250	16.03.33	EUR	100 000	-	-	100 000	102 300.25	0.10
Nestle 3.75% 23-14.11.35 Regs	3.750	14.11.35	EUR	-	500 000	-	500 000	511 849.85	0.48
Nestle Fin 0.0% 20-03.03.33	0.000	03.03.33	EUR	200 000	-	-	200 000	153 298.75	0.14
Nestle Fin 0.875% 22-29.03.27	0.875	29.03.27	EUR	200 000	-	-	200 000	188 621.00	0.18
Nestle Fin 3.25% 24-23.01.37	3.250	23.01.37	EUR	-	400 000	-	400 000	388 396.20	0.36
Nestle Fin 3.75% 23-13.03.33	3.750	13.03.33	EUR	100 000	-	-	100 000	104 180.90	0.10
Nn Group 6.0% 23-03.11.43 Regs	6.000	03.11.43	EUR	200 000	-	-	200 000	216 234.00	0.20
Nordd Lbk 4.875% 23-11.07.28	4.875	11.07.28	EUR	-	400 000	-400 000	-	-	0.00
Novo Nord 3.375% 21.05.34 Regs	3.375	21.05.34	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	998 066.50	0.93
Novo Nordis 3.375% 24-21.05.26	3.375	21.05.26	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	1 000 645.00	0.93
Ntt Leasing 0.082% 21-13.12.25	0.082	13.12.25	EUR	500 000	-	-	500 000	475 932.00	0.44
Nykredit 3.875% 24-09.07.29	3.875	09.07.29	EUR	-	500 000	-	500 000	499 929.52	0.46
Omv 0.75% 20-16.06.30	0.750	16.06.30	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Omv Ag 1% 19-03.07.34 Regs	1.000	03.07.34	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Orange 0.0% 21-29.06.26	0.000	29.06.26	EUR	100 000	-	-	100 000	93 421.47	0.09
Orange 0.125% 20-16.09.29	0.125	16.09.29	EUR	200 000	-	-	200 000	169 611.00	0.16
Orange 0.50% 19-04.09.32	0.500	04.09.32	EUR	100 000	-	-	100 000	79 002.63	0.07
Orange 1.375% 18-20.03.28 Regs	1.375	20.03.28	EUR	100 000	-	-	100 000	93 161.35	0.09
Orange 5.375% 23-Perp Regs	5.375	31.12.99	EUR	500 000	-	-	500 000	518 840.00	0.48
Otp Bank 5.50% 22-13.07.25	5.500	13.07.25	EUR	700 000	-	-	700 000	700 156.94	0.65
Otp Bank 7.35% 22-04.03.26	7.350	04.03.26	EUR	400 000	-	-	400 000	406 508.48	0.38
Pandora 3.875% 24-31.05.30	3.875	31.05.30	EUR	-	200 000	-	200 000	199 428.00	0.19
Pandora 4.50% 23-10.04.28	4.500	10.04.28	EUR	200 000	-	-	200 000	204 901.00	0.19
Pepsico 0.875% 19-16.10.39	0.875	16.10.39	EUR	500 000	-	-	500 000	347 452.50	0.32
Pernod Ric 1.375% 07.04.29 Regs	1.375	07.04.29	EUR	500 000	-	-	500 000	454 264.75	0.42
Piraeus Ban 5% 24-16.04.30	5.000	16.04.30	EUR	-	800 000	-	800 000	798 110.00	0.74
Pko Bank 5.625% 23-01.02.26	5.625	01.02.26	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Prcrhc 9.5% 24-25.07.34	9.500	25.07.34	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	1 029 035.00	0.96
Prologis In 2.375% 18-14.11.30	2.375	14.11.30	EUR	100 000	-	-	100 000	90 796.30	0.08
R Bosch 4.0% 23-02.06.35	4.000	02.06.35	EUR	200 000	-	-	200 000	203 934.84	0.19

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - EUR Corporates (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
R Bosch Inv 2.625% 13-24.05.28	2.625	24.05.28	EUR	800 000	-	-	800 000	777 977.00	0.72
Raiffeisen 6.125% 17-Perp	6.125	31.12.99	EUR	600 000	-	-	600 000	582 259.35	0.54
Raiffeisen 0.375% 19-25.09.26	0.375	25.09.26	EUR	-	400 000	-	400 000	371 110.20	0.34
Raiffeisen 6% (Frn) 23-15.09.28	6.000	15.09.28	EUR	-	300 000	-	300 000	312 205.35	0.29
Raiffeisen 6.0% 20-Perp	6.000	31.12.99	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Raiffeisenb 1.0% 21-09.06.28	1.000	09.06.28	EUR	-	400 000	-	400 000	361 169.50	0.34
Raiffeisenb 4.959% 24-05.06.30	4.959	05.06.30	EUR	-	500 000	-	500 000	500 268.10	0.46
Raiffeisenb 7.125% 23-19.01.26	7.125	19.01.26	EUR	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Red Ele Co 4.625% 23-Perp	4.625	31.12.99	EUR	200 000	-	-	200 000	202 770.00	0.19
Rentokil In 0.50% 20-14.10.28	0.500	14.10.28	EUR	500 000	-	-	500 000	440 899.50	0.41
Roche Fin 3.586% 23-04.12.36	3.586	04.12.36	EUR	-	200 000	-	200 000	201 929.50	0.19
Sagax 2.25% 19-13.03.25	2.250	13.03.25	EUR	400 000	-	-	400 000	394 471.00	0.37
Sage Grp 3.82% 23-15.02.28 Regs	3.820	15.02.28	EUR	400 000	-	-	400 000	401 703.00	0.37
Sampo Bk 2.50% 20-03.09.52	2.500	03.09.52	EUR	400 000	-	-	400 000	345 351.10	0.32
Sanofi 1.125% 16-05.04.28	1.125	05.04.28	EUR	200 000	-	-	200 000	185 511.18	0.17
Sartorius F 4.5% 14-09.32 Regs	4.500	14-09.32	EUR	-	100 000	-	100 000	102 897.22	0.10
Schneid El 1.5% 19-15.01.28	1.500	15.01.28	EUR	500 000	-	-	500 000	472 319.00	0.44
Seb 4.125% 23-29.06.27	4.125	29.06.27	EUR	800 000	-	-	800 000	817 447.20	0.76
Seb 5% 23-17.08.33	5.000	17.08.33	EUR	-	334 000	-	334 000	343 556.91	0.32
Shb 2.625% 22-05.09.29	2.625	05.09.29	EUR	-	200 000	-	200 000	193 891.85	0.18
Shb 3.75% 22-01.11.27 Regs	3.750	01.11.27	EUR	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Shb 5% 23-16.08.34	5.000	16.08.34	EUR	-	100 000	-	100 000	102 990.65	0.10
Siemens Ene 4.0% 23-05.04.26	4.000	05.04.26	EUR	-	400 000	-	400 000	400 449.00	0.37
Siemens Ene 4.25% 23-05.04.29	4.250	05.04.29	EUR	-	500 000	-	500 000	502 493.35	0.47
Siemens Fin 2.75% 22-09.09.30	2.750	09.09.30	EUR	200 000	-	-	200 000	195 147.50	0.18
Siemens Fin 2.875% 13-10.03.28	2.875	10.03.28	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Siemens Fin 3.375% 24-22.02.37	3.375	22.02.37	EUR	-	500 000	-	500 000	488 388.75	0.45
Signify N.V 2.375% 20-11.05.27	2.375	11.05.27	EUR	300 000	-	-	300 000	290 631.82	0.27
Smithkline	1.375	02.12.24	EUR	500 000	-	-	500 000	495 026.25	0.46
Smiths Grou 2% 17-23.02.27	2.000	23.02.27	EUR	250 000	-	-	250 000	239 547.50	0.22
Snr 2.375% 22-06.04.28	2.375	06.04.28	EUR	100 000	-	-	100 000	94 331.42	0.09
Socgen 5.625% 23-02.06.33	5.625	02.06.33	EUR	-	500 000	-	500 000	521 361.45	0.48
Socgen 7.875% 23-Perp	7.875	31.12.99	EUR	-	500 000	-	500 000	509 581.85	0.47
Sodexo 1.0% 20-17.07.28	1.000	17.07.28	EUR	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Sogecap Sa 4.125% /Frn 14-Perp	4.125	31.12.99	EUR	100 000	-	-	100 000	98 629.24	0.09
Sogecap Sa 6.5% 23-16.05.44	6.500	16.05.44	EUR	-	200 000	-	200 000	213 937.00	0.20
Sparebank 1 3.625% 24-30.05.29	3.625	30.05.29	EUR	-	600 000	-	600 000	601 468.50	0.56
Sse 2.875% 22-01.08.29 Regs	2.875	01.08.29	EUR	150 000	-	-	150 000	145 133.10	0.13
St Gobain 3.375% 24-08.04.30	3.375	08.04.30	EUR	-	400 000	-	400 000	394 976.40	0.37
Stedin Hold 2.375% 03.06.30 Regs	2.375	03.06.30	EUR	600 000	-	-	600 000	563 804.70	0.52
Swedbank 4.375% 23-05.09.30	4.375	05.09.30	EUR	-	500 000	-	500 000	516 619.65	0.48
Swiss Life 4.375% 15-Perp	4.375	31.12.99	EUR	1 300 000	-	-	1 300 000	1 295 380.13	1.20
Sydbank 4.75% 22-30.09.25	4.750	30.09.25	EUR	500 000	-	-	500 000	500 823.75	0.47
Sydbank 5.125% 23-06.09.28	5.125	06.09.28	EUR	-	250 000	-	250 000	259 070.00	0.24
Tapestry 5.35% 23-27.11.25	5.350	27.11.25	EUR	-	500 000	-	500 000	508 252.10	0.47
Tdc Net 5.186% 24-02.08.29 Regs	5.186	02.08.29	EUR	-	100 000	-	100 000	101 629.05	0.09
Telefonica 1.201% 20-21.08.27	1.201	21.08.27	EUR	100 000	-	-	100 000	93 392.10	0.09
Telefonica 1.807% 20-21.05.32	1.807	21.05.32	EUR	100 000	-	-	100 000	87 484.23	0.08
Telenor	2.625	06.12.24	EUR	500 000	-	-	500 000	497 542.25	0.46
Tor Dom 1.952% 22-08.04.30 B Regs	1.952	08.04.30	EUR	750 000	-	-400 000	350 000	317 759.75	0.30
Totalen Cap 1.491% 20-08.04.27	1.491	08.04.27	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Totalen Cap 1.618% 20-18.05.40	1.618	18.05.40	EUR	300 000	-	-	300 000	224 463.69	0.21
Transurban 1.45% 19-16.05.29	1.450	16.05.29	EUR	500 000	-	-	500 000	451 185.00	0.42
Tyco Intl	1.375	25.02.25	EUR	600 000	-	-	600 000	590 887.80	0.55
Ubs Group F 0.25% 21-03.11.26	0.250	03.11.26	EUR	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Unibail Rod 4.125% 23-11.12.30	4.125	11.12.30	EUR	-	200 000	-	200 000	200 813.80	0.19
Unilev Cap 3.40% 23-06.06.33	3.400	06.06.33	EUR	200 000	-	-	200 000	199 951.50	0.19
Unilever 1.375% 18-04.09.30	1.375	04.09.30	EUR	400 000	-	-	400 000	359 687.50	0.33

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - EUR Corporates (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Unilever Fi 3.25% 24-15.02.32	3.250	15.02.32	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	995 290.00	0.92
Unipolsai 4.9% 24-23.05.34	4.900	23.05.34	EUR	-	1 500 000	-	1 500 000	1 479 549.38	1.37
United Util 3.75% 24-23.05.34 Regs	3.750	23.05.34	EUR	-	400 000	-	400 000	388 636.00	0.36
Valmet Corp 4% 24-13.03.29	4.000	13.03.29	EUR	-	400 000	-	400 000	399 063.60	0.37
Van Lansch Kemp 8.875% 24-Perp	8.875	31.12.99	EUR	-	500 000	-	500 000	537 656.25	0.50
Verizon Com 0.75% 21-22.03.32	0.750	22.03.32	EUR	100 000	-	-	100 000	81 195.00	0.08
Verizon Com 1.375% 16-02.11.28	1.375	02.11.28	EUR	100 000	-	-	100 000	92 126.73	0.09
Vivat Nv 7% 18-Perp Regs	7.000	31.12.99	EUR	500 000	-	-	500 000	502 469.15	0.47
Vodafone In 3.25% 22-02.03.29	3.250	02.03.29	EUR	200 000	-	-	200 000	198 690.36	0.18
Vodafone In 3.75% 22-02.12.34	3.750	02.12.34	EUR	200 000	-	-	200 000	199 921.34	0.19
Volksbank 4.75% 23-15.03.27	4.750	15.03.27	EUR	800 000	-	-	800 000	821 755.76	0.76
Wolters Klu 0.75% 20-03.07.30	0.750	03.07.30	EUR	300 000	-	-	300 000	257 851.35	0.24
Zuercher Kb 0.0% 21-15.05.26	0.000	15.05.26	EUR	200 000	-	-	200 000	187 983.75	0.17
Zuercher2.02% 22-13.04.28 Regs	2.020	13.04.28	EUR	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
								93 971 567.71	87.27

Indeoptionen

Euro Bund	25.08.23	EUR	-	80	-80	-	-	-	0.00
Euro Bund	25.08.23	EUR	-	80	-80	-	-	-	0.00
								-	0.00

Schatzwechsel

Deutschland 0% 22-19.07.23 Tb	19.07.23	EUR	100	-	-100	-	-	-	0.00
Deutschland 0% 23-13.12.23 Tb	13.12.23	EUR	100	-	-100	-	-	-	0.00
Deutschland 0% 23-15.05.24 Tb	15.05.24	EUR	100	-	-100	-	-	-	0.00
Deutschland 0% 23-17.01.24 Tb	17.01.24	EUR	100	-	-100	-	-	-	0.00
Deutschland 0% 23-17.07.24 Tb	17.07.24	EUR	-	1 000 100	-1 000 000	100	99.85	99.85	0.00
Deutschland 0% 23-18.09.24 Tb	18.09.24	EUR	-	1 000 000	-999 900	100	99.27	99.27	0.00
Deutschland 0% 23-19.06.24 Tb	19.06.24	EUR	100	-	-100	-	-	-	0.00
Deutschland 0% 23-20.03.24 Tb	20.03.24	EUR	100	-	-100	-	-	-	0.00
Deutschland 0% 23-21.02.24 Tb	21.02.24	EUR	100	-	-100	-	-	-	0.00
Deutschland 0% 24-15.01.25 Tb	15.01.25	EUR	-	100	-	100	98.20	98.20	0.00
								297.32	0.00

Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

93 971 865.03 87.27

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Anleihen

Apt Pipelin 2% 15-22.03.27 Regs	2.000	22.03.27	EUR	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Banca Ifis 6.125% 23-19.01.27	6.125	19.01.27	EUR	600 000	-	-600 000	-	-	0.00
Bpce 4.125% 23-10.07.28	4.125	10.07.28	EUR	200 000	-	-	200 000	204 077.10	0.19
Bqe Postale 0.75% 21-23.06.31	0.750	23.06.31	EUR	600 000	-	-	600 000	485 566.50	0.45
Lansbk 3.125% 24-03.05.30	3.125	03.05.30	EUR	-	400 000	-	400 000	399 982.80	0.37
Munhvp 7.125% 23-31.10.28 Regs	7.125	31.10.28	EUR	-	800 000	-800 000	-	-	0.00
Orsted 5.25% 22-08.12.22	5.250	08.12.22	EUR	200 000	-	-	200 000	203 210.00	0.19
Seb	1.375	31.10.28	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Socgen 4.25% 22-06.12.30	4.250	06.12.30	EUR	800 000	-	-	800 000	800 542.80	0.74
Takeda Phar 1.375% 20-09.07.32	1.375	09.07.32	EUR	600 000	-	-	600 000	504 648.36	0.47
Tatra Banka 4.971% 24-29.04.30	4.971	29.04.30	EUR	-	400 000	-	400 000	404 606.00	0.38

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - EUR Corporates (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Telefonica 6.75% 23-Perp	6.750	31.12.99	EUR	-	400 000	-	400 000	434 737.00	0.40
Vr-Group Pl 2.375% 22-30.05.29	2.375	30.05.29	EUR	1 400 000	-	-	1 400 000	1 324 919.61	1.23
								4 762 290.17	4.42
Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere								4 762 290.17	4.42
SUMME WERTPAPIERBESTAND								98 734 155.20	91.69
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								8 263 046.51	7.67
Sonstige Aktiven								680 316.78	0.64
GESAMTNETTOVERMÖGEN								107 677 518.49	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Europe

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
-------------	---	------------------------	---------	------------------------------	--------	-----------	------------------------------	---------------------	------------------------------

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

Aktien

Air Liquide			EUR	7 810	-	-7 810	-	-	0.00
Allianz Se /Nam.Vinkuliert			EUR	5 530	1 300	-530	6 300	1 634 850.00	3.59
Amadeus It – Shs-A-			EUR	17 000	4 000	-	21 000	1 304 940.00	2.87
Antofagasta Plc			GBP	51 500	-	-51 500	-	-	0.00
Ashtead Group Plc			GBP	-	19 000	-	19 000	1 183 695.34	2.60
Asml Holding Nv			EUR	3 290	154	-494	2 950	2 844 390.00	6.25
Asr Nederland Nv			EUR	-	25 000	-	25 000	1 112 750.00	2.45
Astrazeneca Plc			GBP	8 400	6 600	-	15 000	2 186 034.93	4.80
Atlas Copco Rg-A			SEK	84 452	8 000	-14 452	78 000	1 368 947.01	3.01
Bankinter Sa			EUR	125 000	25 000	-	150 000	1 143 900.00	2.51
Befesa S.A.			EUR	12 350	-	-12 350	-	-	0.00
Berkeley Grp Rg			GBP	15 699	4 301	-	20 000	1 082 284.26	2.38
Coca-Cola Hbc			GBP	14 400	-	-14 400	-	-	0.00
Cond Hldgs Rg-Unty			GBP	100 000	86 000	-	186 000	1 083 746.81	2.38
Convatec Group Limited			GBP	-	159 000	-	159 000	440 334.95	0.97
Deutsche Post Ag			EUR	23 700	-	-23 700	-	-	0.00
Diageo Plc			GBP	-	40 000	-	40 000	1 174 519.04	2.58
Diploma Plc			GBP	-	15 000	-	15 000	733 867.99	1.61
Drax Group Plc			GBP	85 000	-	-85 000	-	-	0.00
Essilor International			EUR	5 000	-	-5 000	-	-	0.00
Eurofins Scientific			EUR	-	20 700	-	20 700	963 585.00	2.12
Exor Holding N.V.			EUR	-	12 700	-	12 700	1 240 790.00	2.73
Gsk Plc			GBP	52 000	-	-52 000	-	-	0.00
Halma Plc			GBP	-	25 000	-	25 000	797 913.37	1.75
Julius Baer Grp *Opr*			CHF	14 650	-	-14 650	-	-	0.00
Kone Oyj -B-			EUR	-	26 000	-	26 000	1 198 340.00	2.63
L Oreal			EUR	3 300	400	-	3 700	1 517 185.00	3.33
Logitech Intl Sa			CHF	13 298	-	-13 298	-	-	0.00
Lvmh Act.			EUR	2 400	420	-220	2 600	1 855 360.00	4.08
Neste Oil Oyj			EUR	19 800	2 200	-22 000	-	-	0.00
Nestle / Act Nom			CHF	18 010	3 690	-	21 700	2 066 635.07	4.54
Nordea Bank Abp			SEK	134 000	18 000	-17 000	135 000	1 499 862.87	3.30
Novartis Ag Basel/Nam.			CHF	-	10 000	-	10 000	998 572.57	2.19
Novo Nordisk A/S /-B-			DKK	6 650	-	-6 650	-	-	0.00
Novo Nordisk As -B-			DKK	-	11 050	-	11 050	1 490 033.90	3.27
Osb Grp Rg			GBP	125 947	24 053	-	150 000	758 283.08	1.67
Puma Se			EUR	11 750	2 250	-	14 000	600 180.00	1.32
Qiagen N.V.			EUR	10 800	-	-10 800	-	-	0.00
Reckitt Benckiser Group Plc			GBP	13 600	-	-	13 600	686 868.36	1.51
Roche Holding Ag /Genussschein			CHF	2 700	-	-2 700	-	-	0.00
Schneider Electric Se			EUR	8 000	700	-1 500	7 200	1 614 960.00	3.55
Shell Rg Registered Shs			GBP	40 500	-	-	40 500	1 353 763.52	2.98
Shell Rg Registered Shs			EUR	-	12 500	-	12 500	419 937.50	0.92
Sig Combibloc Group Ag			CHF	36 440	4 060	-5 000	35 500	606 365.20	1.33
Sika Ltd			CHF	3 580	620	-	4 200	1 121 657.52	2.46
Straumann Hldg N			CHF	2 340	4 260	-	6 600	762 744.55	1.68
Stroeer Akt			EUR	6 100	11 400	-	17 500	1 047 375.00	2.30
Swiss Life Holding /Nam			CHF	1 500	-	-1 500	-	-	0.00
Tecan Group Sa /Nam.			CHF	-	2 100	-	2 100	655 899.26	1.44
Ucb			EUR	9 200	1 900	-3 500	7 600	1 054 120.00	2.32
Unilever Plc			EUR	-	36 000	-	36 000	1 846 080.00	4.06
Univ Mu Gr Br Rg			EUR	44 690	8 310	-	53 000	1 472 340.00	3.24

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Europe (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Vinci			EUR	6 920	1 580	-8 500	-	-	0.00
Weir Group Plc			GBP	43 000	-	-43 000	-	-	0.00
								44 923 112.10	98.72
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind								44 923 112.10	98.72
SUMME WERTPAPIERBESTAND								44 923 112.10	98.72
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								356 637.09	0.78
Sonstige Aktiven								226 400.54	0.50
GESAMTNETTOVERMÖGEN								45 506 149.73	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Aktien									
Abbott Laboratories Inc			USD	9 666	12 199	-2 036	19 829	1 922 492.55	1.88
Allianz Se /Nam.Vinkuliert			EUR	8 265	698	-8 963	-	-	0.00
Alphabet Inc -A-			USD	28 285	2 390	-3 812	26 863	4 565 519.43	4.46
American Tower Corp			USD	-	11 694	-	11 694	2 120 904.80	2.07
American Water Works Co Inc			USD	11 316	956	-12 272	-	-	0.00
Ameriprise Financ. /Wh.I			USD	3 699	2 394	-567	5 526	2 202 614.36	2.15
Apple Inc			USD	6 470	2 698	-854	8 314	1 633 864.88	1.59
Arch Capital Gp Ltd Bermuda			USD	40 261	3 401	-20 835	22 827	2 148 836.98	2.10
Arista Networks Inc			USD	13 934	1 177	-4 888	10 223	3 343 090.31	3.26
Asm International Reg Nv			EUR	3 972	336	-402	3 906	2 780 290.80	2.71
Asr Nederland Nv			EUR	-	49 000	-3 884	45 116	2 008 113.16	1.96
Astrazeneca Plc			GBP	12 533	1 059	-1 267	12 325	1 796 192.04	1.75
Avery Dennison Corp			USD	8 342	705	-9 047	-	-	0.00
Biogen Inc			USD	-	4 930	-	4 930	1 066 361.19	1.04
Byd Company Limited -H-			HKD	-	39 500	-3 003	36 497	1 011 920.84	0.99
Cadence Design Systems			USD	12 208	1 031	-2 559	10 680	3 066 731.98	2.99
Carrier Global Corporation			USD	46 383	3 919	-14 867	35 435	2 085 598.13	2.04
Coca-Cola Co.			USD	39 152	2 283	-41 435	-	-	0.00
Colgate-Palmolive Co.			USD	27 247	2 302	-2 753	26 796	2 426 203.72	2.37
Danaher Corp			USD	4 093	346	-4 439	-	-	0.00
Deere & Co.			USD	-	4 991	-465	4 526	1 577 839.40	1.54
Dsm-Firmenich Ltd			EUR	8 823	-	-8 823	-	-	0.00
Ecolab Inc.			USD	-	13 222	-1 152	12 070	2 680 345.23	2.62
Eisai Co.Ltd			JPY	26 427	2 200	-28 627	-	-	0.00
Electronic Arts			USD	-	15 001	-15 001	-	-	0.00
Equinix Inc /Reit			USD	-	3 282	-3 282	-	-	0.00
Ferguson Newco Plc			USD	10 581	5 194	-4 903	10 872	1 964 415.96	1.92
First Solar Inc			USD	-	4 797	-71	4 726	994 190.77	0.97
Flextronics Intl Ltd			USD	82 971	35 883	-10 672	108 182	2 976 708.36	2.91
Fortive Corp			USD	28 830	2 436	-31 266	-	-	0.00
Gilead Sciences Inc.			USD	18 891	1 596	-20 487	-	-	0.00
Hologic Inc			USD	12 967	1 096	-1 116	12 947	896 958.01	0.88
Humana Inc.			USD	-	4 415	-4 415	-	-	0.00
Hydro One Ltd			CAD	31 093	52 949	-7 132	76 910	2 089 875.16	2.04
Infineon Technologies /Nam.			EUR	54 126	4 574	-5 479	53 221	1 825 746.41	1.78
Lkq			USD	35 815	3 026	-38 841	-	-	0.00
Lowe S Companies Inc.			USD	8 517	720	-860	8 377	1 723 156.91	1.68
Mastercard Inc. Shs-A-			USD	4 847	409	-490	4 766	1 961 808.78	1.92
Merck			USD	-	18 676	-1 055	17 621	2 035 437.18	1.99
Microsoft Corp			USD	16 291	1 376	-1 647	16 020	6 680 792.16	6.52
Motorola Soltn /Ex-Distr			USD	8 963	757	-906	8 814	3 174 849.27	3.10
National Grid Plc			GBP	89 356	7 549	-96 905	-	-	0.00
Nextracker Rg-A			USD	-	15 436	-15 436	-	-	0.00
Nice Ltd / Sadr			USD	-	9 764	-774	8 990	1 442 510.19	1.41
Nike Inc -B-			USD	12 420	1 049	-13 469	-	-	0.00
Nordea Bank Abp			SEK	177 560	15 004	-17 879	174 685	1 940 767.01	1.89
Novo Nordisk As -B-			DKK	-	12 200	-361	11 839	1 596 426.37	1.56
Nvidia Corp.			USD	-	24 720	-79	24 641	2 840 353.76	2.77
Owens Corning Inc			USD	17 736	1 498	-6 962	12 272	1 989 168.97	1.94
Phillips-Van Heusen Corp			USD	-	11 183	-11 183	-	-	0.00
Pnc Financial Services Gp			USD	12 050	1 018	-1 216	11 852	1 719 383.21	1.68
Power Integrations Inc			USD	24 896	2 103	-2 515	24 484	1 603 482.12	1.57
Pultegroup Inc			USD	-	17 915	-266	17 649	1 813 067.32	1.77

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Reckitt Benckiser Group Plc			GBP	19 093	1 613	-20 706	-	-	0.00
Reinsurance Grp America Inc			USD	10 892	4 569	-1 209	14 252	2 729 655.27	2.66
Schneider Electric Se			EUR	18 339	989	-7 823	11 505	2 580 571.50	2.52
Sealed Air Corp (New)			USD	36 393	3 075	-39 468	-	-	0.00
Shimano Inc.			JPY	13 109	5 900	-1 308	17 701	2 550 912.35	2.49
Solaredge Technologies Inc			USD	2 909	-	-2 909	-	-	0.00
Sony Grp Sp Sadr			USD	-	18 282	-1 440	16 842	1 334 945.56	1.30
Stantec Inc			CAD	58 881	4 218	-13 999	49 100	3 834 510.75	3.74
Tesla Mtrs			USD	5 438	459	-5 897	-	-	0.00
Tetra Tech Inc.			USD	7 123	602	-720	7 005	1 336 489.29	1.30
Ucb			EUR	20 389	1 723	-7 345	14 767	2 048 182.90	2.00
Unicharm Corp			JPY	38 828	3 200	-3 908	38 120	1 142 483.90	1.12
Vertex Pharmaceuticals			USD	3 607	305	-364	3 548	1 551 685.15	1.51
Vestas Wind Br/Rg			DKK	34 944	2 953	-3 531	34 366	743 082.98	0.73
Workday Inc - Class A			USD	9 098	4 639	-5 969	7 768	1 620 353.70	1.58
							101 178 891.07	98.77	
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind							101 178 891.07	98.77	
SUMME WERTPAPIERBESTAND							101 178 891.07	98.77	
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen							1 254 920.41	1.23	
Sonstige Aktiven							7 331.01	0.00	
GESAMTNETTOVERMÖGEN							102 441 142.49	100.00	

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Real Estate Global

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
-------------	---	------------------------	---------	------------------------------	--------	-----------	------------------------------	---------------------	------------------------------

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

Aktien

Alexandria Real Estate Eq.			USD	8 579	628	-1 405	7 802	851 504.49	3.03
American Tower Corp			USD	3 280	2 365	-740	4 905	889 604.76	3.16
Avalonbay Communities Inc.			USD	4 908	-	-514	4 394	848 215.22	3.02
Boston Properties			USD	11 280	-	-3 678	7 602	436 649.52	1.55
Camden Property Tr./Benef.Int.			USD	9 002	-	-1 226	7 776	791 639.24	2.82
City Developments Ltd			SGD	185 400	50 100	-9 500	226 000	802 869.74	2.86
Ck Asset Hldgs			HKD	124 000	127 500	-63 500	188 000	657 181.17	2.34
Cofinimmo Sa			EUR	4 547	11 663	-403	15 807	890 724.45	3.17
Crown Castle International Shs			USD	5 755	4 038	-393	9 400	856 897.60	3.05
Ctp Br Rg			EUR	133 451	-	-48 590	84 861	1 350 987.12	4.81
Derwent London Plc Reit			GBP	38 723	7 087	-6 440	39 370	1 049 450.10	3.73
Equinix Inc /Reit			USD	1 390	822	-964	1 248	881 023.37	3.13
Equity Residential Sbi			USD	15 248	3 237	-3 812	14 673	949 312.64	3.38
Essex Property Trust			USD	3 790	-	-1 365	2 425	615 894.57	2.19
Goodman Group			AUD	132 766	-	-103 165	29 601	640 983.18	2.28
Healthpeak Properties Inc /Reit			USD	59 707	11 172	-7 351	63 528	1 161 790.34	4.13
Hysan Development Co			HKD	370 000	169 000	-213 000	326 000	437 131.24	1.55
Japan Hotel Reit Invest Corp			JPY	-	648	-	648	292 048.35	1.04
Kilroy Realty Corporation			USD	21 372	-	-10 924	10 448	303 862.06	1.08
Leg Immobilien			EUR	21 384	-	-3 854	17 530	1 336 837.80	4.76
Life Storage Inc /Reit			USD	3 756	-	-3 756	-	-	0.00
Mid-America Apartment Commun.			USD	7 315	658	-4 673	3 300	439 107.07	1.56
Mitsubishi Estate Co.			JPY	99 200	9 900	-33 200	75 900	1 109 432.92	3.95
Mitsui Fudosan Co			JPY	72 400	111 800	-26 900	157 300	1 339 866.12	4.77
Nippon Prologis Reit			JPY	-	629	-	629	915 763.02	3.26
Prologis Inc			USD	23 185	7 418	-6 098	24 505	2 567 909.07	9.13
Public Storage			USD	3 070	-	-123	2 947	790 953.63	2.81
Segro Plc /Reit			GBP	129 001	14 233	-44 806	98 428	1 042 748.69	3.71
Sino Land Co Ltd			HKD	572 000	96 000	-668 000	-	-	0.00
The Link Reit			HKD	162 840	168 100	-97 100	233 840	848 162.15	3.02
Unite Group Plc /Reit			GBP	40 556	86 448	-64 804	62 200	654 399.83	2.33
Vonovia Se /Namen			EUR	68 298	-	-13 135	55 163	1 464 577.65	5.21
Welltower Inc /Reit			USD	7 899	-	-3 157	4 742	461 258.22	1.64
								27 678 785.33	98.47

Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

27 678 785.33 98.47

	01.07.2023	Schlussbestand 30.06.2024	EUR
--	------------	------------------------------	-----

Sonstige übertragbare Wertpapiere

SUMME WERTPAPIERBESTAND

27 678 785.33 98.47

Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen

344 495.22 1.23

Sonstige Aktiven

85 439.72 0.30

GESAMTNETTOVERMÖGEN

28 108 720.27 100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - USA

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
-------------	---	------------------------	---------	------------------------------	--------	-----------	------------------------------	---------------------	------------------------------

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

Aktien

Abbott Laboratories Inc			USD	37 800	14 165	-678	51 287	5 329 232.17	1.75
Activision Blizzard Inc			USD	41 306	-	-41 306	-	-	0.00
Alphabet Inc -C-			USD	74 454	26 707	-31 002	70 159	12 868 563.78	4.24
Amazon Com Inc			USD	40 535	46 850	-959	86 426	16 701 824.50	5.50
American Tower Corp			USD	13 403	15 198	-240	28 361	5 512 811.18	1.82
Ameriprise Financ. /Wh.I			USD	9 644	8 054	-173	17 525	7 486 504.75	2.47
Apple Inc			USD	59 673	18 287	-11 747	66 213	13 945 782.06	4.59
Applied Materials Inc			USD	37 564	14 081	-660	50 985	12 031 950.15	3.96
Arch Capital Gp Ltd Bermuda			USD	76 481	38 836	-52 601	62 716	6 327 417.24	2.08
Arista Networks Inc			USD	27 117	7 487	-7 495	27 109	9 501 162.32	3.13
Biogen Inc			USD	10 701	4 010	-192	14 519	3 365 794.58	1.11
Booking Holdings Inc			USD	1 051	888	-19	1 920	7 606 080.00	2.50
Cadence Design Systems			USD	27 264	10 216	-489	36 991	11 383 980.25	3.75
Calix Networks			USD	41 142	-	-41 142	-	-	0.00
Carrier Global Corporation			USD	98 319	28 314	-24 111	102 522	6 467 087.76	2.13
Coca-Cola Co.			USD	74 295	27 839	-1 332	100 802	6 416 047.30	2.11
Colgate-Palmolive Co.			USD	39 952	39 332	-716	78 568	7 624 238.72	2.51
Conocophillips			USD	35 931	-	-35 931	-	-	0.00
Deere & Co.			USD	10 503	3 936	-188	14 251	5 324 601.13	1.75
Ecolab Inc.			USD	-	16 721	-218	16 503	3 927 714.00	1.29
Electronic Arts			USD	-	33 673	-33 673	-	-	0.00
Facebook Inc -A-			USD	-	8 801	-	8 801	4 437 640.22	1.46
Ferguson Newco Plc			USD	19 746	18 840	-9 015	29 571	5 726 424.15	1.89
Flextronics Intl Ltd			USD	156 441	129 608	-2 805	283 244	8 352 865.56	2.75
Gilead Sciences Inc.			USD	40 189	9 692	-49 881	-	-	0.00
Global Payments Inc			USD	30 740	11 519	-551	41 708	4 033 163.60	1.33
Hess Corp			USD	24 499	9 181	-33 680	-	-	0.00
Hologic Inc			USD	29 796	11 165	-534	40 427	3 001 704.75	0.99
Humana Inc.			USD	-	8 821	-8 821	-	-	0.00
Lilly (Eli) & Co			USD	7 086	2 655	-127	9 614	8 704 323.32	2.87
Lkq			USD	60 197	14 518	-74 715	-	-	0.00
Lowe S Companies Inc.			USD	15 760	5 904	-283	21 381	4 713 655.26	1.55
Mastercard Inc. Shs-A-			USD	9 090	3 406	-163	12 333	5 440 826.28	1.79
Merck			USD	-	34 882	-	34 882	4 318 391.60	1.42
Microsoft Corp			USD	46 111	16 143	-3 807	58 447	26 122 886.65	8.60
Mondelez International Inc Wi			USD	60 083	-	-60 083	-	-	0.00
Motorola Soltn/Ex-Distr			USD	15 323	8 757	-2 740	21 340	8 238 307.00	2.71
Nextracker Rg-A			USD	-	33 333	-33 333	-	-	0.00
Nice Ltd / Sadr			USD	-	24 164	-	24 164	4 155 483.08	1.37
Nike Inc B			USD	24 241	5 846	-30 087	-	-	0.00
Nvidia Corp.			USD	-	103 227	-107	103 120	12 739 444.80	4.19
Occidental Petroleum Corp			USD	-	166 493	-1 206	165 287	10 418 039.61	3.43
Owens Corning Inc			USD	31 847	11 934	-571	43 210	7 506 441.20	2.47
Phillips-Van Heusen Corp			USD	-	27 663	-25 056	2 607	276 003.09	0.09
Pnc Financial Services Gp			USD	35 003	13 116	-628	47 491	7 383 900.68	2.43
Power Integrations Inc			USD	46 588	17 457	-835	63 210	4 436 709.90	1.46
Pultegroup Inc			USD	-	47 895	-	47 895	5 273 239.50	1.74
Reinsurance Grp America Inc			USD	19 522	19 985	-350	39 157	8 037 757.39	2.65
Sealed Air Corp (New)			USD	66 261	-	-66 261	-	-	0.00
Unitedhealth Group Inc			USD	7 383	1 935	-2 315	7 003	3 566 347.78	1.17

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - USA (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Vertex Pharmaceuticals			USD	8 871	3 323	-159	12 035	5 641 045.20	1.86
Workday Inc - Class A			USD	17 601	15 750	-12 365	20 986	4 691 630.16	1.54
							299 037 022.67	98.45	
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind								299 037 022.67	98.45
SUMME WERTPAPIERBESTAND								299 037 022.67	98.45
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								5 057 052.51	1.66
Sonstige Passiven								-359 613.03	-0.11
GESAMTNETTOVERMÖGEN								303 734 462.15	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Aktien									
3I Group Plc			GBP	19 409	38 828	-34 704	23 533	851 015.33	0.27
3M Co			USD	2 757	114	-2 871	-	-	0.00
A.P. Moeller - Maersk A/S A			DKK	-	338	-27	311	492 931.39	0.16
A.P. Moeller - Maersk A/S B			DKK	-	341	-341	-	-	0.00
Accenture Plc			USD	605	770	-149	1 226	347 077.83	0.11
Activision Blizzard Inc			USD	8 192	339	-8 531	-	-	0.00
Adecco Group Sa /Act.Nom.			CHF	8 915	9 131	-3 986	14 060	435 344.41	0.14
Adidas Ag			EUR	-	8 339	-4 837	3 502	780 946.00	0.25
Adobe Systems			USD	432	2 469	-2 113	788	408 458.61	0.13
Advance Auto Parts Inc			USD	4 183	173	-4 356	-	-	0.00
Advanced Micro Devices Inc			USD	-	6 152	-6 152	-	-	0.00
Aena S.A			EUR	-	5 253	-5 253	-	-	0.00
Aercap Holdings Nv			USD	4 785	3 806	-2 726	5 865	510 023.79	0.16
Agilent Technologies			USD	-	3 377	-678	2 699	326 448.68	0.10
Aib Group Plc			EUR	111 270	4 601	-115 871	-	-	0.00
Air Liquide			EUR	1 107	7 646	-6 810	1 943	313 367.04	0.10
Airbnb Rg-A			USD	-	6 002	-	6 002	849 156.30	0.27
Akamai Technologies Inc			USD	-	5 864	-	5 864	492 865.99	0.16
Alcon Inc.			CHF	-	11 013	-11 013	-	-	0.00
Allstate Corp			USD	-	5 402	-	5 402	804 743.01	0.25
Ally Financial Inc			USD	10 015	10 265	-6 319	13 961	516 755.65	0.16
Alnylam Pharmaceuticals Inc			USD	2 447	101	-2 548	-	-	0.00
Alphabet Inc -A-			USD	5 290	4 221	-2 399	7 112	1 208 724.80	0.38
Alphabet Inc -C-			USD	1 505	7 445	-6 934	2 016	345 019.57	0.11
Amazon Com Inc			USD	-	5 591	-668	4 923	887 678.80	0.28
American Express Co.			USD	-	4 513	-835	3 678	794 626.45	0.25
American Water Works Co Inc			USD	-	7 030	-7 030	-	-	0.00
Ameriprise Financ. /Wh.I			USD	-	2 602	-546	2 056	819 503.28	0.26
Ametek Inc			USD	1 250	1 010	-173	2 087	324 631.46	0.10
Amphenol Corporation -A-			USD	-	15 792	-2 216	13 576	853 384.76	0.27
Analog Devices Inc			USD	-	2 979	-2 979	-	-	0.00
Annaly Cap /Reit			USD	14 412	14 610	-2 245	26 777	476 202.12	0.15
Anthem Inc			USD	600	545	-153	992	501 539.65	0.16
Aon Plc -A-			USD	600	3 031	-3 631	-	-	0.00
Apple Inc			USD	1 041	1 016	-240	1 817	357 076.31	0.11
Applied Materials Inc			USD	3 499	2 711	-2 050	4 160	915 995.71	0.29
Aptiv Plc			USD	-	6 460	-138	6 322	415 390.94	0.13
Arc Resources Ltd			CAD	15 033	8 500	-23 533	-	-	0.00
Arch Capital Gp Ltd Bermuda			USD	9 301	15 302	-12 349	12 254	1 153 539.59	0.36
Archer-Daniels Midland Co			USD	3 927	11 101	-6 537	8 491	478 918.54	0.15
Argen-X N.V.			EUR	1 172	48	-1 220	-	-	0.00
Arista Networks Inc			USD	2 899	3 131	-3 019	3 011	984 646.87	0.31
Arrow Electronics Inc.			USD	2 194	1 535	-3 729	-	-	0.00
Asics Corp.			JPY	-	62 000	-	62 000	885 038.24	0.28
Asm International Reg Nv			EUR	-	3 242	-2 008	1 234	878 361.20	0.28
Asml Holding Nv			EUR	262	275	-537	-	-	0.00
Associated British Foods Plc			GBP	-	33 163	-6 415	26 748	780 510.86	0.25
Astrazeneca Plc			GBP	3 246	134	-3 380	-	-	0.00
At & T			USD	18 581	768	-19 349	-	-	0.00
Atlas Copco Rg-B			SEK	14 885	14 137	-7 952	21 070	317 719.70	0.10
Atlassian Corp			USD	-	5 191	-5 191	-	-	0.00
Atmos Energy Corp			USD	4 113	8 358	-4 865	7 606	827 842.22	0.26
Auto Trader Group Plc			GBP	24 732	19 984	-10 993	33 723	318 680.21	0.10

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Automatic Data Procs.			USD	870	1 981	-1 407	1 444	321 593.99	0.10
Autozone Inc			USD	-	334	-334	-	-	0.00
Avalonbay Communities Inc.			USD	1 040	1 089	-318	1 811	349 594.39	0.11
Avery Dennison Corp			USD	-	1 580	-	1 580	322 339.16	0.10
Axon Enterprise			USD	2 437	3 297	-2 538	3 196	877 435.07	0.28
Baker Hughes A Ge Company			USD	15 924	19 346	-7 359	27 911	915 913.10	0.29
Banco Bpm Spa			EUR	-	80 481	-4 133	76 348	459 156.87	0.14
Bank Of Ny Mellon Corp Shs			USD	6 613	5 288	-2 751	9 150	511 307.21	0.16
Barry Callebaut Ag /Nam.			CHF	229	9	-238	-	-	0.00
Bath&Body Works Rg			USD	7 495	8 287	-4 055	11 727	427 281.88	0.13
Baxter Intl Inc			USD	-	15 907	-	15 907	496 467.60	0.16
Bco Bilbao Viz.Argentaria/Nam.			EUR	40 689	181 030	-136 454	85 265	797 398.28	0.25
Bco De Sabadell Sa /Nom.			EUR	-	704 605	-	704 605	1 268 641.30	0.40
Be Semiconductor Industries Nv			EUR	-	6 497	-6 497	-	-	0.00
Beiersdorf A.G.			EUR	3 654	2 938	-985	5 607	765 635.85	0.24
Bentley System-B			USD	-	34 683	-16 881	17 802	819 880.31	0.26
Best Buy Co Inc.			USD	3 860	3 481	-7 341	-	-	0.00
Biogen Inc			USD	-	2 414	-152	2 262	489 271.60	0.15
Blackrock Inc			USD	691	535	-1 226	-	-	0.00
Block -- Registered Shs -A-			USD	-	13 740	-	13 740	826 771.73	0.26
Bmw Ag /Vorzug.			EUR	2 665	3 411	-487	5 589	460 813.05	0.15
Bmw-Bayer.Motorenwerke			EUR	2 504	3 217	-421	5 300	468 414.00	0.15
Bnp Paribas			EUR	-	9 251	-9 251	-	-	0.00
Boc Hong Kong Holdings Ltd			HKD	92 000	147 000	-239 000	-	-	0.00
Booking Holdings Inc			USD	251	247	-173	325	1 201 294.61	0.38
Bouygues			EUR	-	13 765	-	13 765	412 537.05	0.13
Brdrdg Fncl Solutions /Wh.Iss.			USD	-	4 805	-4 805	-	-	0.00
Bristol Myers Squibb Co			USD	4 304	9 006	-623	12 687	491 617.55	0.16
Broadcom Inc			USD	232	163	-395	-	-	0.00
Brookfield - Registered Shs -A			CAD	-	23 683	-23 683	-	-	0.00
Brookfield Rg-Wi			CAD	-	20 739	-	20 739	804 654.20	0.25
Brother Industries Ltd			JPY	-	29 200	-1 900	27 300	448 292.27	0.14
Brown & Brown Inc			USD	7 384	5 369	-2 933	9 820	819 226.69	0.26
Bt Group Plc			GBP	-	421 053	-421 053	-	-	0.00
Builders Firstsource Inc			USD	-	4 909	-1 294	3 615	466 855.28	0.15
Bunge Global N			USD	-	12 518	-7 475	5 043	502 394.32	0.16
Bunge Ltd			USD	3 063	8 705	-11 768	-	-	0.00
Bunzl Plc			GBP	-	23 604	-23 604	-	-	0.00
Burberry Group Plc			GBP	6 988	6 973	-13 961	-	-	0.00
Cadence Design Systems			USD	820	4 133	-3 723	1 230	353 191.04	0.11
Camden Property Tr./Benef.Int.			USD	1 751	2 108	-516	3 343	340 335.65	0.11
Canad.Imper.Bk Of Commerce			CAD	6 620	6 080	-12 700	-	-	0.00
Canadian T.Corp A N-Vot.			CAD	-	5 149	-5 149	-	-	0.00
Capcom Co Ltd			JPY	11 400	13 100	-24 500	-	-	0.00
Carmax /When Issued			USD	-	13 123	-13 123	-	-	0.00
Carrefour S.A.			EUR	-	32 173	-	32 173	424 683.60	0.13
Caterpillar Inc.			USD	-	4 773	-2 078	2 695	837 606.25	0.26
Cboe Global Markets Inc			USD	-	7 633	-599	7 034	1 116 120.40	0.35
Centene Corp. De			USD	4 253	176	-4 429	-	-	0.00
Check Point Software Techno			USD	1 519	4 824	-463	5 880	905 248.43	0.29
Chiba Bank			JPY	-	116 400	-116 400	-	-	0.00
Chugai Pharmaceut. Co.Ltd			JPY	-	29 500	-29 500	-	-	0.00
Church & Dwight Co Inc			USD	-	12 136	-8 870	3 266	315 949.50	0.10
Cigna Corporation			USD	1 100	929	-458	1 571	484 558.40	0.15
Cintas			USD	-	2 399	-1 890	509	332 570.41	0.10
Cisco Systems Inc.			USD	9 417	10 073	-8 363	11 127	493 252.88	0.16
Citizens Financial Group Inc			USD	10 170	10 006	-4 674	15 502	521 144.91	0.16
Clarivate Rg Shs			USD	35 284	39 974	-75 258	-	-	0.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Clorox Co			USD	2 919	6 662	-9 581	-	-	0.00
Cnh Industrial Reg Shs			USD	-	46 419	-46 419	-	-	0.00
Coca-Cola Europ Prntr			USD	7 420	6 439	-13 859	-	-	0.00
Coca-Cola Hbc			GBP	15 898	15 352	-31 250	-	-	0.00
Cognizant Technology Sol A			USD	4 433	4 320	-769	7 984	506 565.90	0.16
Colgate-Palmolive Co.			USD	2 478	12 935	-11 649	3 764	340 805.75	0.11
Comcast Corp/-A-			USD	19 231	15 592	-21 220	13 603	497 031.47	0.16
Commerzbank Akt Nach Kap			EUR	27 430	1 134	-28 564	-	-	0.00
Conagra Brands Inc			USD	-	19 452	-1 796	17 656	468 190.83	0.15
Conocophillips			USD	1 841	76	-1 917	-	-	0.00
Consolidated Edison Inc			USD	5 133	5 743	-10 876	-	-	0.00
Constellation Brand -A-			USD	-	3 526	-	3 526	846 437.40	0.27
Copart Inc			USD	7 491	19 497	-20 475	6 513	329 129.07	0.10
Corning Inc.			USD	-	17 688	-3 376	14 312	518 797.48	0.16
Costco Wholesale Corp			USD	368	1 683	-557	1 494	1 184 870.59	0.37
Credit Agricole Sa. Paris			EUR	24 206	1 001	-25 207	-	-	0.00
Cummins Inc			USD	1 298	3 069	-4 367	-	-	0.00
Cyber-Ark Software Ltd			USD	-	9 089	-5 239	3 850	982 194.54	0.31
Daito Trust Construct.			JPY	1 900	4 800	-3 500	3 200	307 839.39	0.10
Darling Ingred – Shs			USD	4 412	8 509	-12 921	-	-	0.00
Datadog Inc			USD	-	8 111	-	8 111	981 493.44	0.31
Davita Inc – Shs			USD	2 862	13 923	-6 929	9 856	1 274 313.90	0.40
Deckers Outdoor Corp.			USD	-	2 064	-1 733	331	298 942.34	0.09
Deere & Co.			USD	-	1 509	-75	1 434	499 916.42	0.16
Dell Technologies Inc			USD	5 979	13 676	-9 251	10 404	1 338 759.64	0.42
Dexcom Inc			USD	-	8 251	-687	7 564	800 192.51	0.25
Digital Rlty Tr Inc			USD	-	6 083	-	6 083	862 999.91	0.27
Disco Corp.			JPY	-	3 300	-3 300	-	-	0.00
Discover Fin Svc			USD	-	5 700	-5 700	-	-	0.00
Dollarama Inc			CAD	-	4 740	-933	3 807	324 256.95	0.10
Dropbox Inc -A- Shs			USD	-	23 119	-23 119	-	-	0.00
Dufry Ag Basel			CHF	-	14 448	-14 448	-	-	0.00
E.On - Namen Akt.			EUR	38 837	36 420	-75 257	-	-	0.00
Eaton Corporation Public Ltd			USD	-	3 957	-3 957	-	-	0.00
Ebay Inc			USD	10 611	13 810	-24 421	-	-	0.00
Ecolab Inc.			USD	-	5 628	-380	5 248	1 165 406.11	0.37
Edwards Lifesciences			USD	2 208	2 261	-4 469	-	-	0.00
Eiffage Sa			EUR	-	5 588	-5 588	-	-	0.00
Eisai Co.Ltd			JPY	6 800	8 300	-15 100	-	-	0.00
Elanco Animal Health Inc			USD	30 653	-	-30 653	-	-	0.00
Electronic Arts			USD	5 165	8 953	-11 531	2 587	336 316.03	0.11
Element Fleet Management Corp			CAD	30 797	28 258	-59 055	-	-	0.00
Elisa Corporation A			EUR	3 365	4 927	-932	7 360	315 302.40	0.10
Emcor Group Inc.			USD	-	2 393	-	2 393	815 149.47	0.26
Epam Systems			USD	-	3 035	-	3 035	532 693.12	0.17
Equinix Inc /Reit			USD	870	296	-695	471	332 501.61	0.10
Equity Lifestyle			USD	-	5 973	-295	5 678	345 050.75	0.11
Ericsson Tel. B			SEK	54 307	42 758	-97 065	-	-	0.00
Erste Group Bank Ag			EUR	8 444	6 449	-14 893	-	-	0.00
Essex Property Trust			USD	-	1 535	-1 535	-	-	0.00
Eurazeo Act.			EUR	-	8 531	-8 531	-	-	0.00
Everest Group Rg Registered Shs			USD	-	3 499	-2 103	1 396	496 294.77	0.16
Exact Sciences Corp			USD	5 618	11 828	-17 446	-	-	0.00
Exelon Corp			USD	-	23 630	-	23 630	763 083.09	0.24
Expeditors Intl Wash.			USD	1 653	1 522	-289	2 886	336 033.53	0.11
Experian Plc			GBP	5 220	4 268	-9 488	-	-	0.00
Extra Space Storage Inc			USD	-	3 117	-3 117	-	-	0.00
F5 Networks Inc.			USD	-	3 508	-392	3 116	500 740.55	0.16

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Factset Research System Inc			USD	472	515	-96	891	339 415.51	0.11
Fair Isaac Corp			USD	596	767	-1 363	-	-	0.00
Fast Retailing Co Ltd			JPY	1 900	100	-2 000	-	-	0.00
Fastenal			USD	3 403	2 951	-866	5 488	321 778.33	0.10
Ferguson Newco Plc			USD	-	6 794	-6 794	-	-	0.00
Fifth Third Bancorp			USD	10 891	9 733	-20 624	-	-	0.00
First Horizon – Registered Shs			USD	-	44 995	-44 995	-	-	0.00
First Solar Inc			USD	2 278	3 191	-5 469	-	-	0.00
Firstservice – Registered Shs			CAD	1 275	1 217	-125	2 367	336 037.84	0.11
Fiserv Inc.			USD	-	7 422	-7 422	-	-	0.00
Fortescue Metals Group Ltd			AUD	56 042	72 139	-95 140	33 041	440 813.91	0.14
Fortinet			USD	9 679	14 263	-17 812	6 130	344 721.34	0.11
Fortrea Rg-Wi			USD	-	1 303	-1 303	-	-	0.00
Fortune Brands Home & Security			USD	4 395	3 449	-7 844	-	-	0.00
Franco-Nevada Corp			USD	-	3 475	-3 475	-	-	0.00
Franklin Resources Inc.			USD	-	22 525	-	22 525	469 730.58	0.15
Fresenius Medical Care Ag			EUR	-	23 968	-23 968	-	-	0.00
Galp Energia Sgps Sa -B- Shrs			EUR	-	58 110	-58 110	-	-	0.00
Garmin			USD	1 770	7 037	-3 392	5 415	823 150.73	0.26
Gartner Inc. *Opa*			USD	1 365	2 193	-3 558	-	-	0.00
Ge Hlhc Tech Rg-Wi			USD	-	12 605	-12 605	-	-	0.00
Geberit Ag /Namen-Aktien			CHF	-	644	-59	585	322 423.58	0.10
General Mills Inc			USD	5 569	1 130	-6 699	-	-	0.00
Gilead Sciences Inc.			USD	3 629	5 279	-801	8 107	518 984.16	0.16
Godaddy Inc			USD	-	8 652	-2 292	6 360	829 069.84	0.26
Goldman Sachs Group Inc.			USD	-	1 939	-	1 939	818 333.08	0.26
Graco Inc			USD	8 264	2 744	-6 487	4 521	334 429.56	0.11
Gsk Plc			GBP	-	90 338	-48 373	41 965	757 050.15	0.24
H.K.Exchanges And Clearing Ltd			HKD	4 800	7 900	-2 900	9 800	293 031.81	0.09
Hargreaves Lansdown Plc			GBP	-	32 960	-7 037	25 923	346 114.37	0.11
Hca Healthcare Inc			USD	2 748	3 029	-1 522	4 255	1 275 527.32	0.40
Henry Jack & Associates Inc.			USD	1 234	1 075	-125	2 184	338 313.67	0.11
Henry Schein Inc.			USD	-	8 678	-1 072	7 606	454 905.16	0.14
Hermes International			EUR	318	96	-265	149	318 860.00	0.10
Hess Corp			USD	3 524	5 655	-830	8 349	1 149 190.09	0.36
Hewlett Packard Ent Co			USD	18 545	65 171	-53 620	30 096	594 478.49	0.19
Hikma Pharmaceuticals Plc			GBP	-	39 000	-39 000	-	-	0.00
Hologic Inc			USD	5 958	246	-6 204	-	-	0.00
Home Depot Inc.			USD	637	3 420	-2 981	1 076	345 605.08	0.11
Honda Motor Co.Ltd			JPY	9 500	40 300	-49 800	-	-	0.00
Hongkong Land Hlds Ltd Reg			USD	65 600	2 700	-68 300	-	-	0.00
Horizon Pharma Shs			USD	-	4 099	-4 099	-	-	0.00
Host Hotels & Resorts Inc			USD	-	51 203	-51 203	-	-	0.00
Hoya Corp			JPY	-	3 500	-600	2 900	314 640.37	0.10
Hp Inc			USD	9 251	9 774	-4 041	14 984	489 610.15	0.15
Hubspot Inc			USD	-	1 450	-	1 450	797 943.08	0.25
Humana Inc.			USD	1 447	950	-2 397	-	-	0.00
Hunt J.B..Transp.Serv.			USD	-	2 228	-	2 228	332 614.88	0.11
Huntington Bancshares Inc			USD	25 953	25 501	-12 160	39 294	483 223.62	0.15
Hydro One Ltd			CAD	-	12 046	-	12 046	327 325.92	0.10
Iberdrola Sa			EUR	-	65 497	-	65 497	793 496.16	0.25
Ibm			USD	2 134	4 574	-3 509	3 199	516 227.71	0.16
Idex Corp			USD	901	630	-1 531	-	-	0.00
Idexx Laboratories Inc.			USD	-	2 825	-2 106	719	326 845.63	0.10
Igo Registered Shs			AUD	-	124 597	-124 597	-	-	0.00
Illinois Tool Works			USD	822	683	-81	1 424	314 841.19	0.10
Incyte Corporation			USD	-	10 583	-1 539	9 044	511 544.00	0.16
Inditex			EUR	5 501	26 435	-24 847	7 089	328 646.04	0.10

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Infineon Technologies /Nam.			EUR	12 325	510	-12 835	-	-	0.00
Ing Group Nv			EUR	-	63 017	-63 017	-	-	0.00
Inpex Corp			JPY	25 500	73 600	-63 400	35 700	490 145.71	0.15
Insulet Corp			USD	1 676	669	-2 345	-	-	0.00
Intercont Exch			USD	4 362	180	-4 542	-	-	0.00
Interpublic Group			USD	12 181	34 250	-29 264	17 167	465 955.71	0.15
Intertek Group Plc			GBP	3 559	16 944	-747	19 756	1 117 081.83	0.35
Intesa Sanpaolo Spa			EUR	310 354	270 616	-580 970	-	-	0.00
Intuit			USD	1 094	2 206	-1 139	2 161	1 325 151.21	0.42
Intuitive Surgical Inc			USD	1 509	5 225	-4 563	2 171	901 114.39	0.28
Invesco Ltd			USD	18 521	15 788	-34 309	-	-	0.00
Jabil Inc			USD	-	10 995	-6 357	4 638	470 788.92	0.15
Japan Exchange Group Inc			JPY	28 000	42 700	-34 700	36 000	783 473.05	0.25
Jazz Pharmaceuticals Plc			USD	2 202	2 923	-5 125	-	-	0.00
Johnson & Johnson			USD	-	6 102	-129	5 973	814 568.40	0.26
Juniper Networks Inc.			USD	-	17 682	-17 682	-	-	0.00
Kajima Corp.			JPY	-	54 300	-54 300	-	-	0.00
Keycorp			USD	27 493	21 866	-49 359	-	-	0.00
Keyera			CAD	20 207	20 778	-7 295	33 690	870 431.95	0.27
Kimberly Clark Corp			USD	4 846	1 667	-3 905	2 608	336 296.34	0.11
Kingfisher Plc			GBP	-	162 628	-9 603	153 025	449 056.21	0.14
Kla Tencor Corporation			USD	1 028	43	-1 071	-	-	0.00
Koninklijke Kpn /Eur 0.04			EUR	-	105 827	-105 827	-	-	0.00
Kroger Co.			USD	6 155	6 572	-2 548	10 179	474 212.71	0.15
Kuehne +Nagel International			CHF	653	528	-1 181	-	-	0.00
L Oreal			EUR	-	771	-45	726	297 696.30	0.09
La Francaise Des Jeux Saem			EUR	4 825	4 953	-9 778	-	-	0.00
Labcorp Hldgs			USD	-	2 693	-	2 693	511 362.19	0.16
Laboratory Corp Of Amer.Hld			USD	1 303	1 406	-2 709	-	-	0.00
Lam Research Corp			USD	-	1 650	-311	1 339	1 330 379.43	0.42
Lear Corp			USD	-	4 304	-4 304	-	-	0.00
Lennox International Inc.			USD	1 579	2 708	-3 562	725	361 894.57	0.11
Liberty Formul Rg-C			USD	-	11 847	-	11 847	794 111.01	0.25
Liberty Global Plc -A-			USD	17 414	720	-18 134	-	-	0.00
Liberty Global Plc -C-			USD	16 547	684	-17 231	-	-	0.00
Liberty Live Rg-C			USD	-	2 609	-2 609	-	-	0.00
Liberty Media Corp			USD	10 015	-	-10 015	-	-	0.00
Liberty Media Corp			USD	10 022	414	-10 436	-	-	0.00
Liberty-C-Sirxm Rg			USD	-	25 418	-25 418	-	-	0.00
Lilly (Eli) & Co			USD	1 065	1 765	-1 770	1 060	895 453.98	0.28
Linde Plc			EUR	1 829	400	-1 393	836	342 707.67	0.11
Lindt & Spruengli / Reg			CHF	-	8	-1	7	754 458.59	0.24
Live Nation Entertainment Inc			USD	-	16 790	-7 350	9 440	825 664.19	0.26
Lkq			USD	14 022	7 920	-9 354	12 588	488 486.05	0.15
Lloyds Banking Group Plc			GBP	501 107	398 558	-899 665	-	-	0.00
Loews Corp			USD	-	7 011	-	7 011	488 921.99	0.15
Lowe S Companies Inc.			USD	-	4 132	-4 132	-	-	0.00
Lululemon Athletica Inc			USD	1 805	2 221	-2 875	1 151	320 787.22	0.10
Lvmh Act.			EUR	749	192	-941	-	-	0.00
Ly Corp Registered Shs			JPY	-	388 500	-388 500	-	-	0.00
M&T Bank Corporation			USD	-	4 250	-635	3 615	510 535.48	0.16
Manhattan Associates Inc			USD	-	6 014	-4 368	1 646	378 852.61	0.12
Manulife Financial Corp			CAD	14 673	11 764	-26 437	-	-	0.00
Markel Corp.			USD	346	14	-360	-	-	0.00
Marketaxess Holding Inc			USD	669	948	-1 617	-	-	0.00
Marsh & McLennan Cos Inc			USD	3 738	1 072	-4 810	-	-	0.00
Martin Marietta Materials Inc.			USD	-	2 565	-341	2 224	1 124 295.03	0.35
Masco Corp.			USD	5 491	9 817	-2 179	13 129	816 711.39	0.26

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Mastercard Inc. Shs-A-			USD	504	2 509	-2 219	794	326 830.92	0.10
Mcdonald S Corp.			USD	-	1 412	-68	1 344	319 575.42	0.10
Mcdonald S Holdings Co (Japan)			JPY	-	8 600	-	8 600	316 261.58	0.10
Medibank Private Ltd			AUD	280 212	452 887	-733 099	-	-	0.00
Medical Properties Trust Inc			USD	34 258	-	-34 258	-	-	0.00
Mercadolibre Inc			USD	-	699	-699	-	-	0.00
Merck			USD	-	6 859	-	6 859	792 296.90	0.25
Metlife Inc			USD	5 336	10 754	-8 556	7 534	493 409.34	0.16
Metso Rg Registered Shs			EUR	41 331	1 709	-43 040	-	-	0.00
Mettler Toledo Intl Inc.			USD	-	338	-87	251	327 310.56	0.10
Microchip Technology Inc.			USD	6 102	6 600	-12 702	-	-	0.00
Micron Technology Inc			USD	-	10 772	-10 772	-	-	0.00
Microsoft Corp			USD	1 966	2 757	-1 752	2 971	1 238 990.86	0.39
Mid-America Apartment Commun.			USD	1 251	1 660	-279	2 632	350 221.15	0.11
Mineral Resources Ltd			AUD	-	20 652	-20 652	-	-	0.00
Mitsubishi Corp			JPY	6 600	4 300	-10 900	-	-	0.00
Mitsubishi Electric Corp			JPY	33 900	1 400	-35 300	-	-	0.00
Mitsui & Co Ltd			JPY	14 000	600	-14 600	-	-	0.00
Mohawk Industries			USD	2 923	2 801	-5 724	-	-	0.00
Molina Healthcare Inc			USD	-	1 807	-86	1 721	477 399.86	0.15
Moncler S.P.A.			EUR	2 778	3 048	-5 826	-	-	0.00
Monday.Com Rg			USD	-	4 128	-	4 128	927 321.93	0.29
Mondelez International Inc Wi			USD	6 342	262	-6 604	-	-	0.00
Mongodb Inc -A-			USD	-	2 994	-2 994	-	-	0.00
Monolithic Power Systems Inc			USD	-	1 701	-	1 701	1 304 107.94	0.41
Monotaro Co Ltd			JPY	-	38 400	-38 400	-	-	0.00
Moody S Corp			USD	1 441	3 354	-3 926	869	341 299.90	0.11
Motorola Soltn /Ex-Distr			USD	1 666	69	-1 735	-	-	0.00
Msci Inc -A-			USD	394	2 718	-3 112	-	-	0.00
Natwest Grp Rg			GBP	85 938	128 061	-80 040	133 959	492 647.12	0.16
Nec Corp			JPY	-	16 700	-16 700	-	-	0.00
Nemetschek Se			EUR	-	3 911	-168	3 743	343 794.55	0.11
Netapp Inc			USD	-	7 419	-	7 419	891 595.24	0.28
Next Plc			GBP	-	3 699	-3 699	-	-	0.00
Ngk Insulators Ltd			JPY	22 800	15 300	-38 100	-	-	0.00
Nike Inc B			USD	1 748	1 523	-3 271	-	-	0.00
Nintendo Co.Ltd			JPY	4 400	4 300	-2 400	6 300	312 658.37	0.10
Nippon Express H Rg			JPY	4 900	7 000	-900	11 000	473 110.49	0.15
Nitto Denko Corp			JPY	-	5 200	-5 200	-	-	0.00
Nn Group N.V.			EUR	-	11 521	-	11 521	500 587.45	0.16
Nordson Corp			USD	-	1 764	-216	1 548	335 006.41	0.11
Nortonlifelock Rg			USD	15 710	12 694	-7 063	21 341	497 409.08	0.16
Novartis Ag Basel/Nam.			CHF	4 766	9 405	-5 809	8 362	835 006.38	0.26
Novo Nordisk A/S /-B-			DKK	4 232	175	-4 407	-	-	0.00
Novo Nordisk As -B-			DKK	-	15 793	-6 740	9 053	1 220 749.04	0.39
Nucor Corp.			USD	-	3 688	-402	3 286	484 675.42	0.15
Nutrien Ltd			CAD	5 159	6 192	-2 149	9 202	437 031.31	0.14
Nvidia Corp.			USD	1 198	7 678	-1 296	7 580	873 742.20	0.28
Nxp Semiconductor			USD	1 556	4 669	-2 910	3 315	832 314.77	0.26
Occidental Petroleum Corp			USD	-	14 741	-	14 741	866 923.47	0.27
Omnicom Group Inc			USD	-	11 751	-2 073	9 678	809 999.16	0.26
On Semiconductor Corp			USD	5 425	8 242	-6 261	7 406	473 693.77	0.15
Oneok Inc (New)			USD	8 019	7 111	-15 130	-	-	0.00
Open Text Corp			CAD	-	19 056	-	19 056	533 791.17	0.17
Oracle Corp			USD	4 448	3 574	-8 022	-	-	0.00
Oracle Corp Japan Tokyo			JPY	-	4 900	-	4 900	315 484.33	0.10
Otis Worldwide Corporation			USD	2 201	1 540	-3 741	-	-	0.00
Owens Corning Inc			USD	2 490	7 012	-1 452	8 050	1 304 824.82	0.41

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Paccar Inc.			USD	10 282	11 478	-16 760	5 000	480 242.59	0.15
Palo Alto Networks Inc			USD	2 168	1 595	-3 763	-	-	0.00
Pan Pacific H – Reg Shs			JPY	-	42 300	-42 300	-	-	0.00
Panasonic Hldgs Registered Shs			JPY	-	66 500	-5 700	60 800	464 459.75	0.15
Paramount Glb Rg-B Reg Shs B			USD	-	43 275	-	43 275	419 526.24	0.13
Paychex Inc.			USD	1 709	1 469	-269	2 909	321 801.76	0.10
Paycom Software Inc			USD	642	548	-1 190	-	-	0.00
Pentair Plc			USD	-	13 087	-13 087	-	-	0.00
Pepsico Inc			USD	1 024	1 156	-197	1 983	305 160.90	0.10
Pfizer Inc.			USD	-	20 756	-20 756	-	-	0.00
Pnc Financial Services Gp			USD	2 287	1 849	-4 136	-	-	0.00
Pool Corp			USD	577	2 951	-3 528	-	-	0.00
Power Corp.Canada			CAD	-	19 535	-1 308	18 227	472 537.75	0.15
Ppg Industries Inc.			USD	3 375	3 055	-6 430	-	-	0.00
Procter & Gamble Co.			USD	1 286	6 301	-187	7 400	1 138 705.85	0.36
Progressive Corp			USD	-	6 806	-1 023	5 783	1 120 771.57	0.35
Prologis Inc			USD	-	3 130	-3 130	-	-	0.00
Prudential Financial Inc			USD	3 403	2 446	-1 349	4 500	492 050.38	0.16
Public Storage			USD	-	1 364	-72	1 292	346 763.52	0.11
Pultegroup Inc			USD	-	12 512	-	12 512	1 285 347.52	0.41
Qbe Insurance Group			AUD	-	73 466	-	73 466	796 106.95	0.25
Qualcomm Inc.			USD	2 444	8 076	-10 520	-	-	0.00
Quanta Services Inc			USD	-	4 884	-4 884	-	-	0.00
Quest Diagnostics Inc.			USD	-	8 327	-4 585	3 742	477 914.59	0.15
Rational Ag. Landsberg Am Lech			EUR	-	1 775	-1 379	396	307 890.00	0.10
Rb Global Inc Shs			CAD	3 462	2 097	-5 559	-	-	0.00
Rea Group Ltd			AUD	2 070	1 546	-689	2 927	358 694.07	0.11
Recruit Holdings Co.Ltd.			JPY	5 900	21 600	-10 000	17 500	873 672.34	0.28
Regions Financial Corp			USD	15 649	16 073	-3 336	28 386	530 772.51	0.17
Relx Plc			GBP	5 903	4 360	-2 348	7 915	339 719.84	0.11
Renesas Electronics Corp			JPY	26 600	35 800	-62 400	-	-	0.00
Rentokil Initial Plc			GBP	-	150 949	-150 949	-	-	0.00
Resmed Inc			USD	-	4 180	-	4 180	746 569.26	0.24
Robert Half Intl Inc.			USD	6 741	4 621	-11 362	-	-	0.00
Roche Holding Ag /Genussschein			CHF	586	1 646	-241	1 991	515 800.58	0.16
Rockwell Automation			USD	-	3 160	-3 160	-	-	0.00
Rockwool International A/S B			DKK	1 114	944	-2 058	-	-	0.00
S&P Global Shs			USD	-	2 176	-2 176	-	-	0.00
Saint-Gobain			EUR	4 795	3 874	-8 669	-	-	0.00
Salesforce – Registered Shs			USD	2 211	1 928	-4 139	-	-	0.00
Sandoz Group N			CHF	-	992	-992	-	-	0.00
Sba Communications Corp/Reit			USD	835	802	-1 637	-	-	0.00
Scentre Group /Reit			AUD	157 042	149 051	-306 093	-	-	0.00
Schneider Electric Se			EUR	-	3 586	-	3 586	804 339.80	0.25
Screen Hldg – Shs			JPY	-	9 400	-	9 400	790 595.96	0.25
Seagate Hldgs Rg			USD	-	10 775	-1 164	9 611	926 081.61	0.29
Seiko Epson Corp			JPY	-	33 200	-	33 200	481 241.50	0.15
Sensata Tec			USD	6 582	7 901	-14 483	-	-	0.00
Servicenow Inc			USD	-	1 930	-91	1 839	1 349 835.44	0.43
Shell Rg Registered Shs			EUR	16 170	59 360	-50 290	25 240	847 937.80	0.27
Sherwin-Williams Co			USD	-	4 207	-3 052	1 155	321 611.06	0.10
Shimano Inc.			JPY	1 100	1 200	-2 300	-	-	0.00
Shin-Etsu Chemical Co			JPY	-	10 300	-10 300	-	-	0.00
Siemens Ag /Nam.			EUR	2 775	115	-2 890	-	-	0.00
Simon Property /Paired Shs			USD	-	8 106	-	8 106	1 148 113.65	0.36
Sirius Xm Holdings Inc			USD	78 945	3 264	-82 209	-	-	0.00
Skyworks Solutions Inc			USD	2 689	3 409	-298	5 800	576 780.03	0.18
Snap Inc -A-			USD	-	62 257	-2 968	59 289	918 861.95	0.29

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Solaredge Technologies Inc			USD	1 618	1 167	-2 785	-	-	0.00
Solvay Sa			EUR	4 280	177	-4 457	-	-	0.00
Splunk Inc			USD	-	5 667	-5 667	-	-	0.00
Standard Chartered Plc			GBP	-	76 013	-19 298	56 715	478 959.62	0.15
Starbucks Corp.			USD	-	4 684	-419	4 265	309 801.96	0.10
Start Today			JPY	9 000	400	-9 400	-	-	0.00
State Street Corp			USD	3 950	3 710	-677	6 983	482 147.89	0.15
Ste Gen.Paris -A-			EUR	11 682	10 764	-3 458	18 988	416 216.96	0.13
Steris Plc			USD	-	3 790	-3 790	-	-	0.00
Suncorp Group Ltd			AUD	-	96 878	-96 878	-	-	0.00
Svenska Handelsbanken Ab			SEK	-	65 707	-9 734	55 973	497 837.50	0.16
Svitzer Grp Rg			DKK	-	600	-600	-	-	0.00
Swire Pacific Ltd -A-			HKD	-	60 000	-	60 000	494 768.15	0.16
Swiss Re-Namen			CHF	-	8 211	-1 204	7 007	811 235.60	0.26
Swisscom /Nam.			CHF	300	851	-534	617	323 851.82	0.10
Synchrony Financial			USD	8 554	9 265	-5 362	12 457	548 491.56	0.17
Synopsys Inc.			USD	1 468	1 140	-2 608	-	-	0.00
T Rowe Price Group Inc.			USD	1 699	1 409	-3 108	-	-	0.00
Take Two Interact. Software			USD	-	6 412	-1 093	5 319	771 683.05	0.24
Talanx Ag - Namen-Akt			EUR	-	13 211	-13 211	-	-	0.00
Taylor Wimpey Plc			GBP	192 553	134 715	-327 268	-	-	0.00
Te Connectivity /Reg Shs			USD	-	10 437	-6 863	3 574	501 643.87	0.16
Teleflex Inc			USD	-	2 622	-159	2 463	483 361.60	0.15
Teleperform.Se			EUR	-	4 813	-147	4 666	458 854.44	0.14
Terumo Corp.			JPY	-	51 400	-	51 400	790 968.34	0.25
Tesla Mtrs			USD	881	525	-1 406	-	-	0.00
Texas Instruments Inc			USD	1 075	903	-1 978	-	-	0.00
The Kraft Heinz Company			USD	-	15 578	-822	14 756	443 609.35	0.14
The Swatch Group Ag			CHF	967	1 474	-2 441	-	-	0.00
Tjx Companies Inc			USD	8 443	5 918	-11 026	3 335	342 601.82	0.11
T-Mobile Us Inc			USD	3 591	148	-3 739	-	-	0.00
Toyota Tsusho Corp.			JPY	6 100	38 300	-17 100	27 300	495 955.98	0.16
Tractor Supply Co			USD	3 123	3 994	-3 844	3 273	824 548.64	0.26
Trane Technologies Plc			USD	-	2 763	-	2 763	847 990.29	0.27
Travelers Companies Inc *Opr*			USD	2 690	111	-2 801	-	-	0.00
Truist Finl Rg			USD	8 810	10 216	-4 573	14 453	523 908.61	0.17
Twilio Inc -A-			USD	-	9 335	-	9 335	494 818.15	0.16
Ubs Group Ag			CHF	14 207	39 773	-53 980	-	-	0.00
Ucb			EUR	-	6 301	-	6 301	873 948.70	0.28
Ulta Beauty Inc			USD	1 561	370	-1 931	-	-	0.00
Unicharm Corp			JPY	-	10 500	-	10 500	314 692.57	0.10
United Rentals Inc.			USD	782	2 002	-1 385	1 399	844 203.66	0.27
Univ Mu Gr Br Rg			EUR	9 324	5 805	-15 129	-	-	0.00
Upm-Kymmene Corp			EUR	-	23 302	-	23 302	760 111.24	0.24
Uss Co Ltd Tokai			JPY	11 400	35 000	-46 400	-	-	0.00
Valeo Sa			EUR	-	31 786	-31 786	-	-	0.00
Veeva Systems Inc			USD	966	5 554	-4 546	1 974	337 076.50	0.11
Ventas Inc.			USD	-	20 521	-20 521	-	-	0.00
Venture Corporation Ltd			SGD	26 000	1 100	-27 100	-	-	0.00
Verbund Ag /-A-			EUR	-	4 935	-687	4 248	312 865.20	0.10
Verisign Inc			USD	830	1 037	-1 867	-	-	0.00
Verisk Anlytcs			USD	851	741	-225	1 367	343 806.72	0.11
Verizon Communications Inc			USD	8 173	7 938	-3 366	12 745	490 416.42	0.15
Vertex Pharmaceuticals			USD	1 976	1 490	-1 607	1 859	813 016.54	0.26
Vertiv Holdings Llc Npv			USD	-	15 155	-15 155	-	-	0.00
Vici Properties Inc Reit			USD	-	18 127	-	18 127	484 401.47	0.15
Vicinity Centres			AUD	-	420 605	-10 856	409 749	472 362.13	0.15
Visa Inc -A			USD	2 882	733	-2 345	1 270	311 021.13	0.10

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Vmware Inc			USD	3 416	1 974	-5 390	-	-	0.00
Vodafone Group Plc			GBP	294 980	351 055	-111 495	534 540	439 819.64	0.14
Walgreens Boots Alliance Inc			USD	9 061	25 160	-1 341	32 880	371 060.04	0.12
Walmart Inc			USD	-	18 455	-5 200	13 255	837 411.76	0.26
Walt Disney Company			USD	-	8 544	-	8 544	791 540.71	0.25
Warner Bros Discovery Inc			USD	-	65 613	-1 330	64 283	446 247.28	0.14
Wartsila Corporation -B-			EUR	-	62 815	-20 432	42 383	762 894.00	0.24
Webster Financial (Conn)			USD	7 518	5 021	-12 539	-	-	0.00
Welltower Inc /Reit			USD	-	11 542	-11 542	-	-	0.00
Wesfarmers - Shs			AUD	-	7 881	-	7 881	320 096.64	0.10
West Pharmaceutical Services			USD	548	3 573	-240	3 881	1 192 780.58	0.38
Western Digital Corp.			USD	-	16 018	-4 078	11 940	844 127.64	0.27
Westrock Co			USD	-	10 309	-10 309	-	-	0.00
Weyerhaeuser Co			USD	6 535	5 215	-11 750	-	-	0.00
Williams-Sonoma Inc			USD	-	4 371	-	4 371	1 151 611.17	0.36
Wise Plc Ord Shs Gbp 0.01			GBP	-	94 055	-94 055	-	-	0.00
Wix.Com Ltd			USD	6 154	5 615	-6 408	5 361	795 683.95	0.25
Wolters Kluwer Nv			EUR	1 566	1 266	-590	2 242	347 061.60	0.11
Woodside Petrole Rg			AUD	-	17 863	-17 863	-	-	0.00
Workday Inc - Class A			USD	-	3 980	-3 980	-	-	0.00
Worldline Sa			EUR	-	41 388	-41 388	-	-	0.00
Wp Carey Inc Reit			USD	6 671	276	-6 947	-	-	0.00
Ww Grainger Inc			USD	973	277	-852	398	335 051.57	0.11
Yum Brands Shs			USD	1 401	1 129	-2 530	-	-	0.00
Zensho Holdings Co Ltd			JPY	-	18 900	-18 900	-	-	0.00
Zimmer Biomet Hldgs Shs			USD	-	4 669	-	4 669	472 802.96	0.15
Zoetis Inc -A-			USD	-	5 138	-5 138	-	-	0.00
Zscaler Inc			USD	-	5 219	-	5 219	935 889.54	0.30
							165 609 674.82	52.28	

Anleihen

1St Am Fin 4.6% 14-15.11.24	4.600	15.11.24	USD	1 100 000	-	-	1 100 000	1 020 230.34	0.32
Ab Inbev 4% 13-24.09.25 Emtn	4.000	24.09.25	GBP	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
Adbx 5.5% 23-12.01.29	5.500	12.01.29	USD	-	1 710 000	-	1 710 000	1 616 426.67	0.51
Affil Mngrs 3.5% 15-01.08.25	3.500	01.08.25	USD	1 100 000	-	-	1 100 000	1 002 823.19	0.32
Alcon Finan 3% 19-23.09.29	3.000	23.09.29	USD	-	800 000	-800 000	-	-	0.00
Alibaba Grp 3.6% 15-28.11.24	3.600	28.11.24	USD	1 100 000	-	-1 100 000	-	-	0.00
Alim Couche 1.875% 16-06.05.26	1.875	06.05.26	EUR	-	1 600 000	-	1 600 000	1 549 315.20	0.49
Amadeus It 2.50% 20-20.05.24	2.500	20.05.24	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Arrow Elect 6.125% 23-01.03.26	6.125	01.03.26	USD	-	1 700 000	-1 700 000	-	-	0.00
Ashtead Cap 1.5% 21-12.08.26	1.500	12.08.26	USD	-	1 900 000	-1 900 000	-	-	0.00
Ashtead Cap 4.25% 19-01.11.29	4.250	01.11.29	USD	1 100 000	-	-1 100 000	-	-	0.00
Auchan 2.875% 20-29.01.26	2.875	29.01.26	EUR	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Aus 1.5% Notes 21.06.31 1.75%	1.500	21.06.31	AUD	22 700 000	13 000 000	-	35 700 000	12 331 556.60	3.89
Avery Denn 1.25% 17-03.03.25	1.250	03.03.25	EUR	1 470 000	-	-800 000	670 000	658 762.96	0.21
Avnet 4.625% 16-15.04.26	4.625	15.04.26	USD	-	1 700 000	-	1 700 000	1 560 388.43	0.49
Baidu Inc 2.375% 21-23.08.31	2.375	23.08.31	USD	-	1 650 000	-	1 650 000	1 280 975.79	0.40
Baidu Inc 4.375% 18-14.05.24	4.375	14.05.24	USD	1 100 000	-	-1 100 000	-	-	0.00
Banca Comer 7.625% 23-19.05.27	7.625	19.05.27	EUR	-	900 000	-	900 000	945 087.75	0.30
Banco De 3.5% 17-12.10.27	3.500	12.10.27	USD	-	700 000	-700 000	-	-	0.00
Bank Mandiri 3.75% 19-11.04.24	3.750	11.04.24	USD	1 490 000	-	-1 490 000	-	-	0.00
Bankinter 0.875% 19-08.07.26	0.875	08.07.26	EUR	-	700 000	-700 000	-	-	0.00
Bankinter 1% 15-05.02.25	1.000	05.02.25	EUR	-	1 100 000	-	1 100 000	1 081 480.95	0.34
Barry Calbt 2.375% 16-24.05.24	2.375	24.05.24	EUR	1 380 000	-	-1 380 000	-	-	0.00
Bbva 1.125% 20-18.09.25	1.125	18.09.25	USD	-	800 000	-	800 000	707 187.78	0.22
Bc Sant Cl 3.177% 21-26.10.31	3.177	26.10.31	USD	-	1 200 000	-	1 200 000	971 374.33	0.31
Bco Sab 0.625% 19-07.11.25	0.625	07.11.25	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Bcp 1.75% 21-07.04.28	1.750	07.04.28	EUR	-	500 000	-	500 000	471 887.75	0.15

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Belfius Bk 3.125% 16-11.05.26	3.125	11.05.26	EUR	-	1 600 000	-	1 600 000	1 574 997.60	0.50
Bfcm 1.25% 20-05.12.25	1.250	05.12.25	GBP	1 300 000	-	-1 300 000	-	-	0.00
Bfcm 1.875% 19-18.06.29 Regs	1.875	18.06.29	EUR	-	700 000	-	700 000	632 646.35	0.20
Bg Energy 5.125% 10-01.12.25	5.125	01.12.25	GBP	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
Biogen Idec 4.05% 15-15.09.25	4.050	15.09.25	USD	-	1 700 000	-	1 700 000	1 558 227.25	0.49
Biogen Inc 2.25% 20-01.05.30	2.250	01.05.30	USD	-	800 000	-800 000	-	-	0.00
Bk Scotia 3.45% 22-11.04.25	3.450	11.04.25	USD	1 100 000	-	-	1 100 000	1 009 582.51	0.32
Bnpp 4.375% 15-28.09.25 Regs	4.375	28.09.25	USD	-	1 700 000	-	1 700 000	1 558 117.77	0.49
Bnpp 4.4% 18-14.08.28	4.400	14.08.28	USD	-	700 000	-	700 000	627 784.20	0.20
Boardwalk 5.95% 16-01.06.26	5.950	01.06.26	USD	-	1 600 000	-	1 600 000	1 501 146.80	0.47
Bqe Postale 3% 16-09.06.28	3.000	09.06.28	EUR	-	700 000	-	700 000	678 903.23	0.21
Britel 5.125% 18-04.12.28	5.125	04.12.28	USD	-	1 100 000	-	1 100 000	1 023 958.16	0.32
By Lbk 0.125% 21-10.02.28	0.125	10.02.28	EUR	-	700 000	-	700 000	616 378.35	0.19
Ca Ln 1.0% 20-22.04.26	1.000	22.04.26	EUR	-	1 100 000	-1 100 000	-	-	0.00
Caixabank 1.625% 22-13.04.26	1.625	13.04.26	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Campbell S 3.95% 18-15.03.25	3.950	15.03.25	USD	-	1 700 000	-	1 700 000	1 567 205.06	0.49
Carrier 4.125% 23-29.05.28	4.125	29.05.28	EUR	-	600 000	-	600 000	607 167.00	0.19
Cdb Leasing 2.875% 20-28.09.30	2.875	28.09.30	USD	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Cfcm 3.5% 17-09.02.29	3.500	09.02.29	EUR	-	600 000	-	600 000	591 621.00	0.19
Cibc 0.375% 19-03.05.24	0.375	03.05.24	EUR	1 430 000	-	-1 430 000	-	-	0.00
Comzkb 1.125% 17-19.09.25	1.125	19.09.25	EUR	1 100 000	-	-1 100 000	-	-	0.00
Contemporar 2.625% 20-17.09.30	2.625	17.09.30	USD	-	1 600 000	-	1 600 000	1 295 637.23	0.41
Couche-Tard 2.95% 20-25.01.30	2.950	25.01.30	USD	-	800 000	-	800 000	668 149.48	0.21
De Volksban 0.25% 21-22.06.26	0.250	22.06.26	EUR	-	1 700 000	-	1 700 000	1 588 594.75	0.50
De Volksban 0.375% 21-03.03.28	0.375	03.03.28	EUR	-	800 000	-800 000	-	-	0.00
De Volksban 4.875% 23-07.03.30	4.875	07.03.30	EUR	-	400 000	-	400 000	417 217.60	0.13
Depfa 0.10% 21-02.02.26	0.100	02.02.26	EUR	-	700 000	-700 000	-	-	0.00
Depfa 0.25% 22-17.01.25	0.250	17.01.25	EUR	-	1 100 000	-1 100 000	-	-	0.00
Deutschland 1.80% 22-15.08.53	1.800	15.08.53	EUR	5 700 000	2 900 000	-8 600 000	-	-	0.00
Dnb Bank As 2.625% 22-10.06.26	2.625	10.06.26	GBP	-	1 400 000	-1 400 000	-	-	0.00
Dover Corp 1.25% 16-09.11.26	1.250	09.11.26	EUR	-	1 100 000	-1 100 000	-	-	0.00
Dxc Tech 1.75% 18-15.01.26	1.750	15.01.26	EUR	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Ebay 3.6% 17-05.06.27	3.600	05.06.27	USD	1 300 000	-	-1 300 000	-	-	0.00
Eib 4.25% 20-19.06.24	4.250	19.06.24	MXN	20 000 000	10 750 000	-30 750 000	-	-	0.00
Energis Chi 4.875% 18-12.06.28	4.875	12.06.28	USD	-	1 750 000	-	1 750 000	1 579 414.88	0.50
Entel 3.05% 21-14.09.32 /Pool	3.050	14.09.32	USD	-	1 700 000	-	1 700 000	1 281 997.00	0.40
Entel 4.875% 13-30.10.24 /Pool	4.875	30.10.24	USD	1 760 000	-	-	1 760 000	545 105.98	0.17
Erste Bk 1.0% 19-10.06.30	1.000	10.06.30	EUR	-	400 000	-	400 000	386 505.52	0.12
Eurofins 4.0% 22-06.07.29	4.000	06.07.29	EUR	-	600 000	-	600 000	584 982.60	0.18
Eutelsat 1.50% 20-13.10.28	1.500	13.10.28	EUR	-	1 300 000	-1 300 000	-	-	0.00
Fiserv 2.25% 19-01.07.25	2.250	01.07.25	GBP	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
Flex Ltd 4.875% 19-15.06.29	4.875	15.06.29	USD	-	700 000	-	700 000	633 404.45	0.20
Fmg Res 6.125% 22-15.04.32	6.125	15.04.32	USD	-	690 000	-	690 000	636 927.46	0.20
Fr Brnd Hom 3.25% 19-15.09.29	3.250	15.09.29	USD	-	700 000	-	700 000	592 432.62	0.19
Goodman Aus 1.375% 17-27.09.25	1.375	27.09.25	EUR	1 500 000	-	-	1 500 000	1 456 273.68	0.46
Haitong Int 3.375% 19-19.07.24	3.375	19.07.24	USD	1 700 000	-	-	1 700 000	1 584 230.80	0.50
Hasbro Inc 3.55% 19-19.11.26	3.550	19.11.26	USD	-	1 200 000	-	1 200 000	1 069 037.22	0.34
Hkt Capital 3.625% 15-02.04.25	3.625	02.04.25	USD	1 600 000	-	-	1 600 000	1 471 641.59	0.46
Hld Inf Tr 2.5% 20-04.05.27	2.500	04.05.27	EUR	-	1 100 000	-	1 100 000	1 064 617.40	0.34
lenova 3.75% 17-14.01.28	3.750	14.01.28	USD	-	1 860 000	-	1 860 000	1 619 468.11	0.51
Illimity Ba 6.625% 22-09.12.25	6.625	09.12.25	EUR	-	600 000	-	600 000	609 450.00	0.19
Illumina 5.75% 22-13.12.27	5.750	13.12.27	USD	-	700 000	-	700 000	659 438.99	0.21
Ing Groe 4.625% 18-06.01.26 Regs	4.625	06.01.26	USD	-	700 000	-700 000	-	-	0.00
Ing Groep 3% 19-18.02.26	3.000	18.02.26	GBP	1 300 000	-	-1 300 000	-	-	0.00
Isp 4.0% 23-19.05.26	4.000	19.05.26	EUR	-	1 500 000	-1 500 000	-	-	0.00
Isp 8.505% 22-20.09.32	8.505	20.09.32	GBP	-	600 000	-	600 000	767 014.48	0.24
Itv 1.375% 19-26.09.26	1.375	26.09.26	EUR	-	1 700 000	-	1 700 000	1 617 667.30	0.51
Jabil 4.25% 22-15.05.27	4.250	15.05.27	USD	-	700 000	-	700 000	633 098.58	0.20

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Janus Cap 4.875% 15-01.08.25	4.875	01.08.25	USD	1 100 000	-	-	1 100 000	1 016 035.93	0.32
Jnj 0.65% 16-20.05.24	0.650	20.05.24	EUR	1 420 000	-	-1 420 000	-	-	0.00
Johnson&Johns 5.5% 07-06.11.24	5.500	06.11.24	GBP	1 100 000	-	-1 100 000	-	-	0.00
Jyske Bk 4.625% 22-11.04.26	4.625	11.04.26	EUR	-	1 000 000	-1 000 000	-	-	0.00
Kbc 5.796% 23-19.01.29	5.796	19.01.29	USD	-	400 000	-	400 000	376 231.81	0.12
Kellogg Co 1% 16-17.05.24	1.000	17.05.24	EUR	1 420 000	-	-1 420 000	-	-	0.00
Kellogg Co 4.3% 18-15.05.28	4.300	15.05.28	USD	-	700 000	-	700 000	636 485.32	0.20
Keurig Dr P 3.20% 20-01.05.30	3.200	01.05.30	USD	-	800 000	-	800 000	673 598.98	0.21
Keysight 4.55% 15-30.10.24	4.550	30.10.24	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	930 560.64	0.29
Kpn 5.625% 09-30.09.24	5.625	30.09.24	EUR	1 310 000	-	-1 310 000	-	-	0.00
Kvinn Spbk 4.875% 23-24.08.28	4.875	24.08.28	EUR	-	600 000	-	600 000	624 992.22	0.20
Lab Corp 1.55% 21-01.06.26	1.550	01.06.26	USD	-	1 800 000	-	1 800 000	1 560 936.69	0.49
Lbk Bw 2.875% 16-28.09.26	2.875	28.09.26	EUR	-	1 700 000	-	1 700 000	1 655 770.25	0.52
Ldkr B-W 0.375% 19-24.05.24	0.375	24.05.24	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Ldkr B-W 1.50% 20-03.02.25	1.500	03.02.25	GBP	1 300 000	-	-1 300 000	-	-	0.00
Lennox Int 1.35% 20-01.08.25	1.350	01.08.25	USD	1 100 000	-	-	1 100 000	980 138.58	0.31
Lenovo Grp 3.421% 20-02.11.30	3.421	02.11.30	USD	1 700 000	-	-900 000	800 000	660 852.58	0.21
Lg Chem 3.25% 19-15.10.24	3.250	15.10.24	USD	1 600 000	-	-	1 600 000	1 482 300.94	0.47
Lietuvos En 2.0% 20-21.05.30	2.000	21.05.30	EUR	-	1 808 000	-	1 808 000	1 589 546.14	0.50
Lkq Italia 3.875% 16-01.04.24	3.875	01.04.24	EUR	1 360 000	-	-1 360 000	-	-	0.00
Lloyds Bk 4.375% 18-22.03.28	4.375	22.03.28	USD	-	500 000	-	500 000	452 250.52	0.14
Lloyds Bk 4.582% 16-10.12.25	4.582	10.12.25	USD	-	1 700 000	-	1 700 000	1 557 792.60	0.49
Lloyds Bk 4.65% 16-24.03.26	4.650	24.03.26	USD	-	1 100 000	-	1 100 000	1 007 974.23	0.32
Ltd Brands 6.625% 20-01.10.30	6.625	01.10.30	USD	-	660 000	-	660 000	618 244.65	0.20
Lundin Ener 2.0% 21-15.07.26	2.000	15.07.26	USD	1 200 000	-	-	1 200 000	1 041 976.79	0.33
Macquarie G 1.201% 21-14.10.25	1.201	14.10.25	USD	-	1 100 000	-	1 100 000	1 011 632.79	0.32
Masco Corp 1.50% 21-15.02.28	1.500	15.02.28	USD	-	800 000	-	800 000	655 174.95	0.21
Mastercard 2.0% 19-03.03.25	2.000	03.03.25	USD	1 200 000	-	-1 200 000	-	-	0.00
Meituan Dnp 3.05% 20-28.10.30	3.050	28.10.30	USD	-	900 000	-900 000	-	-	0.00
Mineral Res 8.5% 22-01.05.30	8.500	01.05.30	USD	-	630 000	-	630 000	609 159.89	0.19
Mol 1.50% 20-08.10.27	1.500	08.10.27	EUR	-	1 740 000	-1 740 000	-	-	0.00
Molnycke H 1.75% 15-28.02.24	1.750	28.02.24	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Motorola Sol. 7.5% 95-15.05.25	7.500	15.05.25	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	944 693.26	0.30
Natwest 4.269% 19-22.03.25	4.269	22.03.25	USD	1 100 000	-	-1 100 000	-	-	0.00
Natwest Mar 0.125% 21-12.11.25	0.125	12.11.25	EUR	1 100 000	-	-1 100 000	-	-	0.00
Nibc Bk Nv 0.875% 19-08.07.25	0.875	08.07.25	EUR	1 500 000	-	-	1 500 000	1 455 961.28	0.46
Nibc Bk Nv 6.375% 23-01.12.25	6.375	01.12.25	EUR	-	600 000	-	600 000	618 966.60	0.20
Opmobility 4.875% 13.03.29 Regs	4.875	13.03.29	EUR	-	600 000	-	600 000	594 383.10	0.19
Otp Bank 7.50% 23-25.05.27	7.500	25.05.27	USD	-	700 000	-	700 000	670 152.93	0.21
P&G 1.125% 15-02.11.23	1.125	02.11.23	EUR	1 400 000	-	-1 400 000	-	-	0.00
Popular Inc 7.25% 23-13.03.28	7.250	13.03.28	USD	-	800 000	-	800 000	762 368.09	0.24
Qnb Fin 2.75% 20-12.02.27	2.750	12.02.27	USD	-	1 100 000	-	1 100 000	964 490.18	0.30
Raiffeisen 7% 23-12.10.27	7.000	12.10.27	EUR	-	500 000	-	500 000	525 000.00	0.17
Raiffeisen 0.375% 19-25.09.26	0.375	25.09.26	EUR	-	1 800 000	-	1 800 000	1 669 995.90	0.53
Raiffeisen 4.84% 23-03.11.28	4.840	03.11.28	EUR	-	600 000	-	600 000	626 479.44	0.20
Raiffeisenb 1.0% 21-09.06.28	1.000	09.06.28	EUR	-	1 100 000	-	1 100 000	993 216.13	0.31
Rba Croatia 7.875% 23-05.06.27	7.875	05.06.27	EUR	-	400 000	-	400 000	424 831.00	0.13
Rural Elec 3.50% 19-12.12.24	3.500	12.12.24	USD	1 800 000	-	-	1 800 000	1 661 500.35	0.52
Rural Elec 5.625% 23-11.04.28	5.625	11.04.28	USD	-	700 000	-	700 000	657 206.44	0.21
Ryder Syst 5.65% 23-01.03.28	5.650	01.03.28	USD	-	700 000	-	700 000	663 457.22	0.21
Schneid El 0.875% 15-11.03.25	0.875	11.03.25	EUR	1 400 000	-	-1 400 000	-	-	0.00
Seb 0.25% 17-20.06.24	0.250	20.06.24	EUR	1 440 000	-	-1 440 000	-	-	0.00
Shinhan Fg 3.34% 19-05.02.30	3.340	05.02.30	USD	-	700 000	-	700 000	643 871.01	0.20
Signify N.V 2.0% 20-11.05.24	2.000	11.05.24	EUR	1 400 000	-	-1 400 000	-	-	0.00
Signify N.V 2.375% 20-11.05.27	2.375	11.05.27	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	968 772.72	0.31
Sk Brdband 3.875% 18-13.08.23	3.875	13.08.23	USD	1 580 000	-	-1 580 000	-	-	0.00
Sk Hynix 3% 19-17.09.24	3.000	17.09.24	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 855 303.01	0.59
Snr 2.375% 22-06.04.28	2.375	06.04.28	EUR	-	1 340 000	-	1 340 000	1 264 040.96	0.40

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Socgen 1.125% 20-21.04.26	1.125	21.04.26	EUR	-	1 100 000	-1 100 000	-	-	0.00
Socgen 4.25% 16-19.08.26 Regs	4.250	19.08.26	USD	-	700 000	-	700 000	626 142.66	0.20
Std Chart 4.3% 16-19.02.27	4.300	19.02.27	USD	-	700 000	-	700 000	634 586.73	0.20
Swedbank 0.20% 21-12.01.28	0.200	12.01.28	EUR	-	700 000	-	700 000	621 796.00	0.20
Sydbank 4.75% 22-30.09.25	4.750	30.09.25	EUR	-	1 000 000	-	1 000 000	1 001 647.50	0.32
Sysco Corp 5.95% 20-01.04.30	5.950	01.04.30	USD	-	700 000	-	700 000	680 454.47	0.22
Tapestry Inc 4.25% 15-01.04.25	4.250	01.04.25	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	923 021.47	0.29
Tele2 Ab 1.125% 18-15.05.24	1.125	15.05.24	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Teleperf 1.875% 18-02.07.25	1.875	02.07.25	EUR	-	1 600 000	-	1 600 000	1 567 470.00	0.50
Tencent Music 2% 20-03.09.30	2.000	03.09.30	USD	-	900 000	-	900 000	697 677.75	0.22
Transport 5.55% 18-01.11.28 Regs	5.550	01.11.28	USD	1 350 000	-	-700 000	650 000	589 958.93	0.19
Tyco Elect 3.45% 14-01.08.24	3.450	01.08.24	USD	1 100 000	-	-	1 100 000	1 023 689.36	0.32
Verisign 5.25% 15-01.04.25	5.250	01.04.25	USD	-	1 700 000	-1 700 000	-	-	0.00
Verizon Com Frn 18-15.05.25	6.680	15.05.25	USD	1 100 000	-	-	1 100 000	1 036 697.17	0.33
Vmware Inc 1.80% 21-15.08.28	1.800	15.08.28	USD	-	800 000	-	800 000	654 377.49	0.21
Vmware Inc 3.9% 17-21.08.27	3.900	21.08.27	USD	1 600 000	-	-	1 600 000	1 433 001.32	0.45
Vmware Inc 4.50% 20-15.05.25	4.500	15.05.25	USD	1 100 000	-	-	1 100 000	1 016 741.75	0.32
Volksbank 0.875% 21-23.03.26	0.875	23.03.26	EUR	-	1 700 000	-	1 700 000	1 610 481.83	0.51
Xylem 1.95% 20-30.01.28	1.950	30.01.28	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
York Build 0.50% 21-01.07.28	0.500	01.07.28	EUR	-	700 000	-	700 000	622 043.80	0.20
Zimmer Biom 5.35% 23-01.12.28	5.350	01.12.28	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	939 487.38	0.30
								114 293 162.47	36.08

Anlagefonds

Jss In Sueq Sem Shs I Usd Acc Cap	31.12.99	USD	156 824	7 100	-	163 924	10 383 765.21	3.27
							10 383 765.21	3.27

Indexoptionen

Euro Stoxx 50 Pr	20.12.24	EUR	-	-	-81	-81	-29 565.00	-0.01
Euro Stoxx 50 Pr	20.12.24	EUR	-	-	-81	-81	-52 245.00	-0.02
Euro Stoxx 50 Pr	20.12.24	EUR	-	81	-	81	129 195.00	0.04
Euro Stoxx 50 Pr	15.12.23	EUR	-140	236	-96	-	-	0.00
Euro Stoxx 50 Pr	15.12.23	EUR	-140	140	-	-	-	0.00
Euro Stoxx 50 Pr	15.12.23	EUR	140	96	-236	-	-	0.00
Euro Stoxx 50 Pr	19.04.24	EUR	-	120	-120	-	-	0.00
Euro Stoxx 50 Pr	19.04.24	EUR	-	120	-120	-	-	0.00
Euro Stoxx 50 Pr	19.04.24	EUR	-	120	-120	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices	20.12.24	USD	-	60	-	60	407 781.67	0.13
Spx - S&P 500 Indices	20.12.24	USD	-	-	-60	-60	-130 328.90	-0.04
Spx - S&P 500 Indices	20.12.24	USD	-	-	-60	-60	-711 546.54	-0.22
Spx - S&P 500 Indices	15.12.23	USD	-110	110	-	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices	15.12.23	USD	110	62	-172	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices	15.12.23	USD	-110	110	-	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices	19.04.24	USD	-	100	-100	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices	19.04.24	USD	-	100	-100	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices	19.04.24	USD	-	100	-100	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices	19.04.24	USD	-	100	-100	-	-	0.00
Spx - S&P 500 Indices	19.04.24	USD	-	100	-100	-	-	0.00
							-386 708.77	-0.12

Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

289 899 893.73 91.51

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Anleihen

Academy Ltd 6% 20-15.11.27	6.000	15.11.27	USD	-	670 000	-	670 000	616 794.53	0.20
Adtlm Gbl 5.5% 21-01.03.28	5.500	01.03.28	USD	-	710 000	-	710 000	636 734.36	0.20

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Amn Health 4% 20-15.04.29	4.000	15.04.29	USD	-	770 000	-	770 000	646 678.29	0.20
Bbva 5.862% 22-14.09.26	5.862	14.09.26	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	933 403.22	0.30
Bpce 4.875% 16-01.04.26	4.875	01.04.26	USD	-	1 700 000	-	1 700 000	1 555 255.90	0.49
Cascades 5.375% 19-15.01.28	5.375	15.01.28	USD	-	700 000	-	700 000	629 634.37	0.20
Cgi Inc 1.45% 22-14.09.26	1.450	14.09.26	USD	-	1 900 000	-	1 900 000	1 623 824.12	0.51
J2 Global 4.625% 20-15.10.30	4.625	15.10.30	USD	-	760 000	-	760 000	641 904.04	0.20
Macy S Reta 6.125% 22-15.03.32	6.125	15.03.32	USD	-	900 000	-	900 000	802 851.64	0.25
Moh 3.875% 21-15.05.32	3.875	15.05.32	USD	-	800 000	-	800 000	647 686.42	0.20
Natl Bk 3.75% 22-09.06.25	0.000	09.06.25	USD	1 100 000	-	-1 100 000	-	-	0.00
Nxp 5.55% 21-01.12.28	5.550	01.12.28	USD	-	1 350 000	-	1 350 000	1 277 493.51	0.40
Nxp Bv/Nxp 2.50% 22-11.05.31	2.500	11.05.31	USD	-	1 650 000	-	1 650 000	1 293 246.72	0.41
Pernod Rica 1.25% 20-01.04.28	1.250	01.04.28	USD	-	1 200 000	-	1 200 000	974 126.48	0.31
Prime Sec 4.875% 16-15.07.32	4.875	15.07.32	USD	-	700 000	-	700 000	600 334.89	0.19
Promigas/Ga 3.75% 19-16.10.29 Regs	3.750	16.10.29	USD	1 500 000	-	-700 000	800 000	678 828.61	0.21
Resideo 4% 21-01.09.29	4.000	01.09.29	USD	-	800 000	-	800 000	659 234.80	0.21
Sally Hldgs 6.75% 24-01.03.32	6.750	01.03.32	USD	-	700 000	-	700 000	645 881.82	0.20
Sp Pls 4.50% 21-15.03.29	4.500	15.03.29	USD	-	740 000	-	740 000	634 483.08	0.20
Steelcase 5.125% 19-18.01.29	5.125	18.01.29	USD	-	720 000	-	720 000	636 878.92	0.20
Swedbank 5.337% 22-20.09.27	5.337	20.09.27	USD	-	700 000	-	700 000	651 234.81	0.21
Td Synnex 1.25% 22-09.08.24	1.250	09.08.24	USD	1 700 000	-	-	1 700 000	1 577 777.04	0.50
Td Synnex 1.75% 22-09.08.26	1.750	09.08.26	USD	-	700 000	-	700 000	603 001.20	0.19
Tegna 5% 19-15.09.29	5.000	15.09.29	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	824 815.12	0.26
Telekom Malay. 7.875% 95-25 Reg.S	7.875	01.08.25	USD	690 000	-	-	690 000	657 030.65	0.21
Tempur Seal 3.875% 21-15.10.31	3.875	15.10.31	USD	-	800 000	-	800 000	626 340.10	0.20
Us Foods 4.75% 21-15.02.29	4.750	15.02.29	USD	-	700 000	-	700 000	620 014.84	0.20
Wesco Dis 6.625% 24-15.03.32	6.625	15.03.32	USD	-	670 000	-	670 000	632 659.42	0.20
							22 328 148.90	7.05	
Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere							22 328 148.90	7.05	
SUMME WERTPAPIERBESTAND							312 228 042.63	98.56	
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen							4 340 773.09	1.37	
Sonstige Aktiven							216 687.32	0.07	
GESAMTNETTOVERMÖGEN							316 785 503.04	100.00	

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Green Planet

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Aktien									
Aalberts – Bearer Shs			EUR	119 106	19 845	-11 128	127 823	4 847 048.16	1.22
Advanced Drainage Systems			USD	56 803	11 668	-	68 471	10 246 852.06	2.57
Agilent Technologies			USD	51 522	3 459	-4 854	50 127	6 062 946.59	1.52
Aker Carbon Rg			NOK	606 625	-	-606 625	-	-	0.00
American Water Works Co Inc			USD	77 304	4 448	-28 108	53 644	6 464 808.99	1.62
Analog Devices Inc			USD	34 547	2 908	-11 015	26 440	5 631 158.76	1.42
Arcadis N.V.			EUR	179 236	16 753	-	195 989	11 592 749.35	2.91
Aurubis Ag			EUR	60 617	10 117	-21 759	48 975	3 587 418.75	0.90
Autodesk Inc.			USD	23 598	8 687	-5 776	26 509	6 120 505.76	1.54
Byd Company Limited -H-			HKD	-	137 000	-	137 000	3 798 480.85	0.95
Cadeler Rg			NOK	506 310	96 036	-	602 346	3 557 671.91	0.89
Carbios Sa			EUR	14 035	6 015	-	20 050	414 032.50	0.10
Cimc Enric Hldg			HKD	3 399 446	-	-3 399 446	-	-	0.00
Clean Harbors Inc			USD	78 185	5 506	-13 526	70 165	14 805 518.78	3.72
Coca-Cola Europ Prntr			USD	147 408	-	-22 687	124 721	8 479 980.66	2.13
Danaher Corp			USD	41 863	2 455	-30 551	13 767	3 209 409.80	0.81
Darling Ingred – Shs			USD	64 514	19 415	-83 929	-	-	0.00
Duerr Ag			EUR	59 999	-	-59 999	-	-	0.00
Ebara Corp.			JPY	121 378	496 012	-	617 390	9 108 567.19	2.29
Ecolab Inc.			USD	40 631	10 883	-	51 514	11 439 544.67	2.87
Entegris Inc			USD	48 016	4 487	-	52 503	6 632 989.22	1.67
First Solar Inc			USD	-	24 190	-	24 190	5 088 758.95	1.28
Flsmidth & Co. A/S B			DKK	110 384	24 067	-19 838	114 613	5 320 709.54	1.34
Georg Fischer N			CHF	66 022	2 636	-4 285	64 373	4 027 177.91	1.01
Gfl Environment Inc			USD	-	147 356	-	147 356	5 352 525.38	1.35
Hydro One Ltd			CAD	284 796	71 666	-	356 462	9 686 140.66	2.43
IDEX Corp			USD	17 093	1 598	-7 995	10 696	2 007 963.80	0.50
Infineon Technologies /Nam.			EUR	217 526	32 935	-	250 461	8 592 064.61	2.16
Kurita Water Ind.Ltd			JPY	198 558	24 200	-	222 758	8 810 747.06	2.21
Lundin Mining Corp			CAD	496 888	8 945	-505 833	-	-	0.00
Masco Corp.			USD	80 834	-	-	80 834	5 028 414.07	1.26
Metso Rg Registered Shs			EUR	1 050 018	98 143	-84 689	1 063 472	10 511 357.25	2.64
Microsoft Corp			USD	41 035	7 889	-	48 924	20 402 688.87	5.13
National Grid Plc			GBP	675 693	343 882	-	1 019 575	10 613 803.43	2.67
On Semiconductor Corp			USD	141 654	12 726	-22 551	131 829	8 431 889.85	2.12
Pennon Grp Rg			GBP	236 768	-	-236 768	-	-	0.00
Ptc Inc Shs			USD	77 551	7 247	-	84 798	14 373 923.64	3.61
Republic Services Inc.			USD	114 860	19 075	-15 877	118 058	21 407 410.05	5.38
Right National Grid Plc			GBP	-	230 226	-230 226	-	-	0.00
Right Natl Grid P 10.06.24 /Sous			GBP	-	230 227	-230 227	-	-	0.00
Rohm Co.Ltd			JPY	48 981	164 743	-66 037	147 687	1 841 787.25	0.46
Roper Technologies Inc			USD	24 900	3 149	-2 638	25 411	13 364 277.36	3.36
Rotork Plc			GBP	1 074 113	100 386	-	1 174 499	4 665 655.55	1.17
Samsung Sdi / Sgdr 144A			EUR	38 972	-	-38 972	-	-	0.00
Schneider Electric Se			EUR	-	13 324	-	13 324	2 988 573.20	0.75
Siemens Ag /Nam.			EUR	72 469	9 696	-	82 165	14 273 703.80	3.59
Sika Ltd			CHF	19 489	3 433	-	22 922	6 121 579.42	1.54
Solaredge Technologies Inc			USD	28 791	2 024	-30 815	-	-	0.00
Stantec Inc			CAD	169 710	15 861	-30 629	154 942	12 100 341.43	3.04
Stmicroelectronics Nv			EUR	133 815	5 542	-	139 357	5 137 395.81	1.29
Sulzer Ag/ Namensaktien			CHF	57 870	1 042	-6 581	52 331	6 748 708.12	1.70
Synopsys Inc.			USD	-	13 273	-	13 273	7 369 471.78	1.85
Tetra Tech Inc.			USD	46 447	4 340	-	50 787	9 689 690.47	2.43

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/ „Splits“ /Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/ „Reversesplits“ /Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Green Planet (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in EUR	% des Netto- vermögens
Thermo Fisher Scientific Inc			USD	20 878	1 813	-1 862	20 829	10 747 317.00	2.70
Trimble Navigation Ltd			USD	73 480	5 061	-19 868	58 673	3 061 342.81	0.77
Valeo Sa			EUR	134 059	33 549	-167 608	-	-	0.00
Valmont Ind.Inc			USD	25 655	2 398	-	28 053	7 183 714.35	1.81
Veolia Environnement			EUR	416 993	64 122	-33 274	447 841	12 503 720.72	3.14
Veralto Rg-Wi			USD	-	28 433	-	28 433	2 532 772.11	0.64
Vestas Wind Br /Rg			DKK	200 758	26 145	-50 697	176 206	3 810 035.51	0.96
Xylem Inc			USD	89 528	13 196	-	102 724	12 999 725.79	3.27
							392 795 071.55	98.69	
Optionen auf Wertpapiere									
Right Carbios 07.07.23 /Sous		07.07.23	EUR	14 035	-	-14 035	-	-	0.00
								-	0.00
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind							392 795 071.55	98.69	
SUMME WERTPAPIERBESTAND							392 795 071.55	98.69	
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen							6 344 495.17	1.59	
Sonstige Passiven							-1 134 546.67	-0.28	
GESAMTNETTOVERMÖGEN							398 005 020.05	100.00	

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Bond - USD High Yield

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
-------------	---	------------------------	---------	------------------------------	--------	-----------	------------------------------	---------------------	------------------------------

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

Aktien

American Axle & Manufact.Hldgs			USD	18 298	5 375	-3 325	20 348	142 232.52	0.08
Ardagh Mp Rg			USD	47 090	13 350	-9 875	50 565	171 921.00	0.10
Boyd Gaming			USD	3 330	945	-715	3 560	196 156.00	0.12
Brinks Co.			USD	4 035	1 100	-1 145	3 990	408 576.00	0.24
Caesars Entertainment Inc			USD	6 425	4 750	-1 295	9 880	392 631.20	0.23
Callon Petroleum Rg			USD	-	5 050	-5 050	-	-	0.00
Cumulus Media Inc Npv			USD	30 777	2 245	-33 022	-	-	0.00
Dell Technologies Inc			USD	5 190	1 115	-3 585	2 720	375 115.20	0.22
Devon Energy Corp.(New)			USD	3 080	1 450	-700	3 830	181 542.00	0.11
Ecovyst Rg			USD	-	20 875	-	20 875	187 248.75	0.11
Energizer Holdings Inc			USD	8 140	2 395	-1 480	9 055	267 484.70	0.16
Enviva Inc			USD	6 520	660	-7 180	-	-	0.00
Gms Inc			USD	4 435	945	-2 740	2 640	212 810.40	0.13
Graphic Packaging Holding Co			USD	14 691	4 035	-3 445	15 281	400 515.01	0.24
Iheartmedia Registered Shs -A-			USD	39 115	4 775	-43 890	-	-	0.00
Interface Inc			USD	-	20 050	-1 335	18 715	274 736.20	0.16
Koppers Holdings Inc			USD	10 245	1 965	-5 490	6 720	248 572.80	0.15
Lear Corp			USD	1 045	320	-220	1 145	130 770.45	0.08
Lumentum Holdings Inc			USD	4 660	550	-5 210	-	-	0.00
Nabor Industries Rg			USD	-	2 485	-	2 485	176 832.60	0.11
Nrg Energy Inc			USD	7 420	1 940	-5 745	3 615	281 463.90	0.17
O-I Glass Rg			USD	19 010	5 115	-5 105	19 020	211 692.60	0.13
Pioneer Natural Resources Co			USD	873	100	-973	-	-	0.00
Post Holding Shs-When Issued			USD	-	2 310	-	2 310	240 609.60	0.14
Red Rock Resorts Inc			USD	4 745	1 395	-860	5 280	290 030.40	0.17
Science Applications Intl Corp			USD	2 640	775	-470	2 945	346 184.75	0.21
Stagwell Rg-A			USD	72 757	19 955	-19 615	73 097	498 521.54	0.30
Suburban Propane Partners Units			USD	18 704	5 140	-3 605	20 239	384 338.61	0.23
Townsquare Media Inc			USD	18 070	-	-18 070	-	-	0.00
Us Foods Holding Corp			USD	6 455	1 795	-1 430	6 820	361 323.60	0.22
Viavi Solutions Inc			USD	-	34 300	-	34 300	235 641.00	0.14
Vistra Energy Corp			USD	11 725	2 305	-8 020	6 010	516 739.80	0.31
Wesco International Inc			USD	-	1 785	-100	1 685	267 106.20	0.16
Westrock Co			USD	3 845	1 850	-1 865	3 830	192 495.80	0.12
							7 593 292.63	4.54	

Anleihen

Ally Fin 5.75% 15-20.11.25	5.750	20.11.25	USD	125 000	100 000	-	225 000	223 801.26	0.13
Amerigas	5.500	20.05.25	USD	350 000	-	-306 000	44 000	43 850.52	0.03
Amerigas Fi	5.875	20.08.26	USD	775 000	-	-550 000	225 000	218 185.25	0.13
Ard Fin 6.5% 19-30.06.27/Pik 144A	6.500	30.06.27	USD	1 154 186	-	-175 000	979 186	249 212.63	0.15
Ball Corp 6.0% 23-15.06.29	6.000	15.06.29	USD	125 000	-	-	125 000	125 877.50	0.08
Ball Corp 6.875% 22-15.03.28	6.875	15.03.28	USD	175 000	-	-	175 000	179 617.20	0.11
Bausch 7.25% 19-30.05.29 144A	7.250	30.05.29	USD	650 000	-	-225 000	425 000	221 835.13	0.13
Carnival 7.625% 01.03.26 144A	7.625	01.03.26	USD	-	100 000	-	100 000	101 063.00	0.06
Chen Eng 3.25% 21-31.01.32	3.250	31.01.32	USD	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Csc Hldg 7.5% -01.04.28	7.500	01.04.28	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Dolya Holdc 5.0% 20-15.07.28 144A	5.000	15.07.28	USD	325 000	-	-	325 000	289 522.55	0.17
Eqtd Mdstm 5.5% 18-15.07.28	5.500	15.07.28	USD	475 000	-	-	475 000	468 123.76	0.28
Eqtd Mdstm 6.5% 18-15.07.48	6.500	15.07.48	USD	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Ford Mc 3.375% 20-13.11.25	3.375	13.11.25	USD	675 000	-	-	675 000	653 504.02	0.39
Ford Mc 4.0% 20-13.11.30	4.000	13.11.30	USD	850 000	-	-	850 000	759 889.60	0.45
Ford Mc 4.063% 19-01.11.24	4.063	01.11.24	USD	400 000	-	-	400 000	397 735.92	0.24

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Bond - USD High Yield (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Ford Mc 4.125% 20-17.08.27	4.125	17.08.27	USD	350 000	-	-	350 000	332 769.37	0.20
Ford Mc 4.271% 20-09.01.27	4.271	09.01.27	USD	475 000	-	-475 000	-	-	0.00
Ford Mc 4.389% 16-08.01.26	4.389	08.01.26	USD	325 000	-	-	325 000	318 237.34	0.19
Ford Mc 5.113% 19-03.05.29	5.113	03.05.29	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Ford Mc 5.125% 20-16.06.25	5.125	16.06.25	USD	1 800 000	-	-325 000	1 475 000	1 464 277.65	0.87
Graphic Pac 4.75% 19-15.07.27	4.750	15.07.27	USD	175 000	-	-	175 000	171 201.49	0.10
Graphic Packagn 3.5% 20-01.03.29	3.500	01.03.29	USD	75 000	-	-	75 000	67 624.90	0.04
Grifols 4.75% 21-15.10.28 144A	4.750	15.10.28	USD	925 000	25 000	-	950 000	820 503.98	0.49
Hca	5.375	01.02.25	USD	225 000	-	-	225 000	224 273.93	0.13
Hca	5.875	15.02.26	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Hillenbrand 6.25% 24-15.02.29	6.250	15.02.29	USD	-	500 000	-	500 000	503 129.50	0.30
Iheartcomm 6.375% 19-01.05.26	6.375	01.05.26	USD	50 000	-	-50 000	-	-	0.00
Iheartcomm 8.375% 19-01.05.27	8.375	01.05.27	USD	1 289 891	-	-1 139 891	150 000	55 609.82	0.03
Iho Verwalt 6% 19-15.05.27 /Pik	6.000	15.05.27	USD	600 000	-	-	600 000	590 982.12	0.35
Intelsat Rg Registered Shs	0.000	31.12.99	USD	-	17	-17	-	-	0.00
Mgm Resorts 6.5% 24-15.04.32	6.500	15.04.32	USD	-	400 000	-	400 000	398 442.16	0.24
Navient 5.50% 21-15.03.29	5.500	15.03.29	USD	725 000	-	-200 000	525 000	480 760.56	0.29
Navient 6.75% 17-25.06.25	6.750	25.06.25	USD	175 000	-	-175 000	-	-	0.00
Navient 6.75% 18-15.06.26	6.750	15.06.26	USD	500 000	-	-	500 000	503 528.50	0.30
Occidental 5.875% 20-01.09.25	5.875	01.09.25	USD	300 000	-	-	300 000	300 338.49	0.18
Occidental 6.125% 20-01.01.31	6.125	01.01.31	USD	150 000	-	-150 000	-	-	0.00
Occidental 6.625% 20-01.09.30	6.625	01.09.30	USD	325 000	-	-325 000	-	-	0.00
Range Resou	4.875	15.05.25	USD	125 000	-	-	125 000	124 316.96	0.07
Schaef	4.750	15.09.26	USD	650 000	-	-	650 000	630 403.93	0.38
Seagate Hdd 9.625% 22-01.12.32	9.625	01.12.32	USD	666 625	-	-666 625	-	-	0.00
Sm Energy	5.625	01.06.25	USD	275 000	-	-	275 000	273 999.30	0.16
Sm Energy	6.750	15.09.26	USD	400 000	-	-	400 000	400 446.00	0.24
Sprint Corp	7.125	15.06.24	USD	475 000	-	-475 000	-	-	0.00
Sthwest En 4.75% 21-01.02.32	4.750	01.02.32	USD	200 000	-	-	200 000	184 013.68	0.11
Sthwest En 5.375% 21-15.03.30	5.375	15.03.30	USD	125 000	-	-	125 000	120 792.46	0.07
Tenet Hlthc 4.25% 23-01.06.29	4.250	01.06.29	USD	425 000	-	-	425 000	396 620.69	0.24
Transdi 6.375% 17-15.06.26	6.375	15.06.26	USD	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Transdigm 5.50% 20-15.11.27	5.500	15.11.27	USD	650 000	-	-375 000	275 000	270 305.60	0.16
Transdigm 7.50% 19-15.03.27	7.500	15.03.27	USD	550 000	-	-550 000	-	-	0.00
Transdigm U 6.875% 18-15.05.26	6.875	15.05.26	USD	325 000	-	-325 000	-	-	0.00
Trivium Pack 5.5% 19-15.08.26	5.500	15.08.26	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Usacmpr Ptr 6.875% 18-01.04.26	6.875	01.04.26	USD	800 000	-	-800 000	-	-	0.00
Usagm Holdc 9.75% 19-15.07.27	9.750	15.07.27	USD	1 450 000	-	-600 000	850 000	845 437.97	0.51
Utd Rent Na 3.75% 21-15.01.32	3.750	15.01.32	USD	175 000	-	-	175 000	152 476.43	0.09
Utd Rent Na 3.875% 20-15.02.31	3.875	15.02.31	USD	300 000	-	-	300 000	267 924.98	0.16
Utd Rent Na 4.0% 20-15.07.30	4.000	15.07.30	USD	250 000	-	-	250 000	226 384.68	0.14
Veritas Us 7.50% 20-01.09.25	7.500	01.09.25	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Western Gas 4.5% 18-01.03.28	4.500	01.03.28	USD	150 000	-	-150 000	-	-	0.00
Western Gas 4.65% 16-01.07.26	4.650	01.07.26	USD	50 000	-	-	50 000	49 065.33	0.03
Western Gas 4.75% 18-15.08.28	4.750	15.08.28	USD	125 000	-	-	125 000	122 318.13	0.07
Western Gas 5.3% 18-01.03.48	5.300	01.03.48	USD	425 000	-	-425 000	-	-	0.00
Yum Brands 3.625% 20-15.03.31	3.625	15.03.31	USD	75 000	-	-75 000	-	-	0.00
Yum Brands 4.625% 21-31.01.32	4.625	31.01.32	USD	175 000	-	-	175 000	161 137.88	0.10
Ziggo	6.000	15.01.27	USD	1 000 000	-	-375 000	625 000	613 550.63	0.37
Ziggo Bv 4.875% 19-15.01.30	4.875	15.01.30	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
							15 003 092.80		8.96
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind							22 596 385.43		13.50

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Bond - USD High Yield (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden									
Anleihen									
1011778 Bc 4.0% 20-15.10.30	4.000	15.10.30	USD	2 425 000	-	-625 000	1 800 000	1 583 975.84	0.95
1011778 Bc 6.125% 24-15.06.29	6.125	15.06.29	USD	-	175 000	-	175 000	176 016.84	0.11
Academy Ltd 6.0% 20-15.11.27 144A	6.000	15.11.27	USD	425 000	-	-	425 000	419 322.47	0.25
Acrisure LI 7.5% 24-06.11.30	7.500	06.11.30	USD	-	450 000	-	450 000	451 179.32	0.27
Acushet 7.375% 23-15.10.28 144A	7.375	15.10.28	USD	-	75 000	-75 000	-	-	0.00
Adapthealth 4.625% 21-01.08.29	4.625	01.08.29	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Adapthealth 5.125% 21-01.03.30	5.125	01.03.30	USD	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Adient Glob	4.875	15.08.26	USD	975 000	-	-	975 000	948 903.35	0.57
Adient Glob 7% 23-15.04.28 144A	7.000	15.04.28	USD	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Affinity 6.875% 15.12.28 144A	6.875	15.12.27	USD	675 000	-	-350 000	325 000	287 127.91	0.17
Albertsons 3.50% 20-15.03.29 144A	3.500	15.03.29	USD	225 000	-	-225 000	-	-	0.00
Albertsons 5.875% 15.02.28 144A	5.875	15.02.28	USD	250 000	-	-	250 000	247 280.70	0.15
Albertsons 6.5% 23-15.02.28 144A	6.500	15.02.28	USD	400 000	-	-	400 000	402 741.60	0.24
Albertsons 7.5% 19-15.03.26 144A	7.500	15.03.26	USD	175 000	-	-	175 000	177 603.83	0.11
Albertsons C 3.25% 15.03.26 144A	3.250	15.03.26	USD	175 000	-	-175 000	-	-	0.00
Allied Univ 6.0% 21-01.06.29 144A	6.000	01.06.29	USD	825 000	-	-	825 000	722 993.04	0.43
Allied Univ 7.875% 24-15.02.31 144A	7.875	15.02.31	USD	-	250 000	-	250 000	250 899.25	0.15
Alnt Hldgs 6.75% 19-15.10.27 144A	6.750	15.10.27	USD	-	200 000	-	200 000	197 453.20	0.12
Amer Bld 4.0% 19-15.01.28 144A	4.000	15.01.28	USD	425 000	-	-	425 000	397 334.29	0.24
Ams 7.0% 20-31.07.25 144A	7.000	31.07.25	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Ams-Osram 12.25% 23-30.03.29	12.250	30.03.29	USD	-	200 000	-200 000	-	-	0.00
Amwins Grou 4.875% 30.06.29 144A	4.875	30.06.29	USD	1 100 000	-	-175 000	925 000	861 955.52	0.52
Amwins Grou 6.375% 24-15.02.29	6.375	15.02.29	USD	-	125 000	-	125 000	125 424.13	0.07
Antero 5.75% 19-01.03.27 144A	5.750	01.03.27	USD	1 125 000	-	-225 000	900 000	893 432.34	0.53
Antero 5.75% 19-15.01.28	5.750	15.01.28	USD	625 000	-	-	625 000	614 652.29	0.37
Antero 6.625% 24-01.02.32 144A	6.625	01.02.32	USD	-	125 000	-	125 000	126 201.25	0.08
Antero 7.625% 21-01.02.29 144A	7.625	01.02.29	USD	110 000	-	-	110 000	113 344.44	0.07
Antero 7.875% 20-15.05.26 144A	7.875	15.05.26	USD	225 000	-	-225 000	-	-	0.00
Antero Mid 5.375% 21-15.06.29	5.375	15.06.29	USD	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Antero Res 5.375% 21-01.03.30	5.375	01.03.30	USD	175 000	-	-75 000	100 000	96 856.63	0.06
Aramark Ser 6.375% 20-01.05.25 144A	6.375	01.05.25	USD	550 000	-	-550 000	-	-	0.00
Archrock 6.25% 19-01.04.28	6.250	01.04.28	USD	725 000	-	-275 000	450 000	446 067.54	0.27
Archrock P 6.875% 19-01.04.27	6.875	01.04.27	USD	750 000	-	-	750 000	753 618.75	0.45
Ardagh Meta 4.0% 21-01.09.29	4.000	01.09.29	USD	250 000	200 000	-	450 000	381 351.33	0.23
Ardagh Pck 5.25% 19-15.08.27 144A	5.250	15.08.27	USD	625 000	-	-	625 000	389 819.88	0.23
Ardagh Pck 5.25% 20-15.08.27 144A	5.250	15.08.27	USD	900 000	-	-200 000	700 000	436 598.26	0.26
Ardent H S 5.75% 21-15.07.29	5.750	15.07.29	USD	325 000	-	-	325 000	309 074.71	0.18
Ardonagh 8.875%-15.02.32 144A	8.875	15.02.32	USD	-	1 350 000	-	1 350 000	1 319 781.47	0.79
Ardonagh Fi 7.75% 24-15.02.31	7.750	15.02.31	USD	-	200 000	-	200 000	197 837.96	0.12
Ardonagh Mi 11.50% 20-15.01.27 144A	11.500	15.01.27	USD	921 438	-	-921 438	-	-	0.00
Artera 8.5% 24-15.02.31 144A	8.500	15.02.31	USD	-	150 000	-	150 000	154 522.05	0.09
Asbury Auto 4.625% 21-15.11.29	4.625	15.11.29	USD	250 000	-	-	250 000	231 414.30	0.14
Asbury Auto 5.0% 21-15.02.32	5.000	15.02.32	USD	300 000	-	-	300 000	272 072.94	0.16
Ascent Reso 5.875% 21-30.06.29	5.875	30.06.29	USD	200 000	-	-	200 000	195 595.06	0.12
Ascent Reso 7% 18-01.11.26 144A	7.000	01.11.26	USD	300 000	-	-	300 000	300 492.60	0.18
Ascent Reso 8.25% 20-31.12.28	8.250	31.12.28	USD	250 000	-	-	250 000	256 361.75	0.15
Assuredpart 5.625% 20-15.01.29	5.625	15.01.29	USD	525 000	-	-	525 000	491 605.01	0.29
Assuredpart 7% 17-15.08.25 144A	7.000	15.08.25	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Audacy Capital 6.75% 31.03.29	6.750	31.03.29	USD	450 000	-	-	450 000	16 312.50	0.01
Avantor 4.625% 20-15.07.28 144A	4.625	15.07.28	USD	650 000	-	-	650 000	619 189.35	0.37
Avantor Fdg 3.875% 21-01.11.29	3.875	01.11.29	USD	500 000	-	-175 000	325 000	295 820.40	0.18
Axalta 4.75% 20-15.06.27 144A	4.750	15.06.27	USD	150 000	-	-	150 000	145 989.77	0.09
Axalta Coat 3.375% 20-15.02.29	3.375	15.02.29	USD	150 000	-	-	150 000	134 441.09	0.08
Axalta Coat 7.25% 15.02.31 144A	7.250	15.02.31	USD	-	150 000	-	150 000	155 952.90	0.09

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Bond - USD High Yield (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Baldwin 7.125% 24-15.05.31 144A	7.125	15.05.31	USD	-	400 000	-	400 000	405 180.40	0.24
Ball Corp 3.125% 21-15.09.31	3.125	15.09.31	USD	275 000	-	-	275 000	232 861.64	0.14
Bausch 5.0% 19-30.01.28	5.000	30.01.28	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Bausch 5.0% 20-15.02.29	5.000	15.02.29	USD	500 000	-	-75 000	425 000	206 269.50	0.12
Bausch 5.25% 19-30.01.30	5.250	30.01.30	USD	350 000	-	-350 000	-	-	0.00
Bausch 5.25% 20-15.02.31 144A	5.250	15.02.31	USD	350 000	-	-75 000	275 000	128 937.88	0.08
Bausch 6.125% 22-01.02.27	6.125	01.02.27	USD	75 000	-	-	75 000	62 521.88	0.04
Bausch 6.25% 20-15.02.29 144A	6.250	15.02.29	USD	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Bausch HI 5.75% 19-15.08.27	5.750	15.08.27	USD	175 000	-	-	175 000	139 625.08	0.08
Bcpe 7.625% 21-01.05.27 144A	7.625	01.05.27	USD	1 275 000	-	-	1 275 000	1 236 385.61	0.74
Beacon Sup 6.5% 23-01.08.30	6.500	01.08.30	USD	-	100 000	-	100 000	101 004.60	0.06
Bellring Br 7.0% 22-15.03.30	7.000	15.03.30	USD	500 000	-	-	500 000	512 937.50	0.31
Berry Glb 5.625% 19-15.07.27 144A	5.625	15.07.27	USD	575 000	-	-	575 000	566 290.94	0.34
Berry Petr 7% 18-15.02.26	7.000	15.02.26	USD	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Blue Racer 7% 24-15.07.29	7.000	15.07.29	USD	-	100 000	-	100 000	101 908.28	0.06
Blue Racer 7.25% 24-15.07.32	7.250	15.07.32	USD	-	125 000	-	125 000	128 432.75	0.08
Boxer 9.125% 20-01.03.26 144A	9.125	01.03.26	USD	575 000	-	-	575 000	577 335.08	0.34
Boyd Gam 4.75% 19-01.12.27 144A	4.750	01.12.27	USD	250 000	-	-	250 000	241 075.38	0.14
Boyd Gam 4.75% 21-15.06.31	4.750	15.06.31	USD	150 000	-	-	150 000	136 052.79	0.08
Brinks Co 6.5% 24-15.06.29 144A	6.500	15.06.29	USD	-	250 000	-	250 000	252 858.15	0.15
Brinks Co 6.75% 24-15.06.32	6.750	15.06.32	USD	-	250 000	-	250 000	252 205.58	0.15
Broadstreet 5.875% 21-15.04.29	5.875	15.04.29	USD	1 750 000	-	-375 000	1 375 000	1 284 383.93	0.77
Bway 7.875% 23-15.08.26	7.875	15.08.26	USD	425 000	-	-425 000	-	-	0.00
Caesars 4.625% 21-15.10.29 144A	4.625	15.10.29	USD	225 000	-	-	225 000	206 412.37	0.12
Caesars25 5.75% 20-01.07.25 144A	5.750	01.07.25	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Callon Petr 6.375% 18-01.07.26	6.375	01.07.26	USD	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Callon Petroleum Co 7.5% 144A	7.500	15.06.30	USD	175 000	-	-175 000	-	-	0.00
Calpine 4.50% 19-15.02.28	4.500	15.02.28	USD	150 000	-	-	150 000	142 638.89	0.09
Calpine 4.625% 20-01.02.29 144A	4.625	01.02.29	USD	225 000	-	-225 000	-	-	0.00
Calpine 5.0% 20-01.02.31	5.000	01.02.31	USD	225 000	225 000	-	450 000	420 302.07	0.25
Calpine 5.125% 19-15.03.28 144A	5.125	15.03.28	USD	275 000	-	-	275 000	264 711.81	0.16
Calpine 5.25% 16-01.06.26 144A	5.250	01.06.26	USD	125 000	-	-	125 000	123 731.83	0.07
Camelot Ret 8.75% 22-01.08.28	8.750	01.08.28	USD	350 000	-	-75 000	275 000	269 708.92	0.16
Capstone 8.0% 23-15.06.30	8.000	15.06.30	USD	475 000	50 000	-100 000	425 000	439 429.60	0.26
Carnival 6.0% 21-01.05.29 144A	6.000	01.05.29	USD	-	75 000	-	75 000	74 157.38	0.04
Carnival 7% 23-15.08.29	7.000	15.08.29	USD	-	100 000	-	100 000	103 724.25	0.06
Carrizo 8.25% 17-15.07.25	8.250	15.07.25	USD	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Cars.Com 6.375% 20-01.11.28	6.375	01.11.28	USD	600 000	-	-100 000	500 000	491 758.25	0.29
Cbs Out Am 4.625% 19-15.03.30	4.625	15.03.30	USD	150 000	-	-	150 000	135 290.76	0.08
Cbs Out Am 5% 19-15.08.27	5.000	15.08.27	USD	225 000	-	-	225 000	217 930.03	0.13
Cbs Out Am 7.375% 23-15.02.31	7.375	15.02.31	USD	-	50 000	-	50 000	52 096.05	0.03
Cbs Radio I 6.5% 19-01.05.27 144A	6.500	01.05.27	USD	750 000	-	-	750 000	27 187.50	0.02
Ccm Merger 6.375% 20-01.05.26	6.375	01.05.26	USD	75 000	-	-	75 000	74 512.15	0.04
Cco Hldgs 4.25% 20-01.02.31 144A	4.250	01.02.31	USD	575 000	-	-	575 000	469 850.50	0.28
Cco Hldgs 4.25% 21-15.01.34 144A	4.250	15.01.34	USD	575 000	-	-	575 000	437 757.68	0.26
Cco Hldgs 4.50% 20-01.05.32	4.500	01.05.32	USD	650 000	-	-	650 000	525 485.35	0.31
Cco Hldgs 4.50% 20-15.08.30	4.500	15.08.30	USD	425 000	-	-200 000	225 000	190 653.98	0.11
Cco Hldgs 4.50% 21-01.06.33	4.500	01.06.33	USD	325 000	-	-	325 000	256 115.11	0.15
Cco Hldgs 4.75% 19-01.03.30 144A	4.750	01.03.30	USD	225 000	-	-100 000	125 000	108 343.60	0.06
Cco Hldgs 5% 17-01.02.28 144A	5.000	01.02.28	USD	800 000	-	-	800 000	748 552.48	0.45
Cco Hldgs 5.125% 01.05.27 144A	5.125	01.05.27	USD	425 000	-	-75 000	350 000	336 337.89	0.20
Cco Hldgs 5.375% 19-01.06.29 144A	5.375	01.06.29	USD	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Centene Esc 4.25% 19-15.12.27	4.250	15.12.27	USD	550 000	-	-550 000	-	-	0.00
Centenn 5.375% 17-15.01.26 144A	5.375	15.01.26	USD	125 000	-	-	125 000	123 788.06	0.07
Centennial 6.875% 01.04.27 144A	6.875	01.04.27	USD	575 000	-	-575 000	-	-	0.00
Central Par 7.25% 22-15.06.29	7.250	15.06.29	USD	550 000	225 000	-	775 000	771 788.94	0.46
Central Par 8% 23-15.06.29	8.000	15.06.29	USD	-	175 000	-	175 000	177 855.30	0.11
Cheever Esc 7.125% 22-01.10.27	7.125	01.10.27	USD	200 000	-	-	200 000	201 458.40	0.12

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Bond - USD High Yield (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Chen Eng 4.0% 21-01.03.31	4.000	01.03.31	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Chen Eng 4.50% 20-01.10.29	4.500	01.10.29	USD	325 000	-	-325 000	-	-	0.00
Cheniere En 4.625% 21-15.10.28	4.625	15.10.28	USD	275 000	-	-275 000	-	-	0.00
Chs 5.25% 22-15.05.30	5.250	15.05.30	USD	200 000	-	-	200 000	164 904.82	0.10
Chs 6.0% 20-15.01.29 144A	6.000	15.01.29	USD	75 000	125 000	-	200 000	176 791.20	0.11
Chs 6.125% 21-01.04.30	6.125	01.04.30	USD	175 000	-	-	175 000	122 640.02	0.07
Chs 6.875% 21-15.04.29	6.875	15.04.29	USD	950 000	-	-425 000	525 000	402 267.55	0.24
Chs 8% 19-15.03.26 144A	8.000	15.03.26	USD	350 000	-	-350 000	-	-	0.00
Chs 8.0% 19-15.12.27	8.000	15.12.27	USD	125 000	-	-125 000	-	-	0.00
Churchill 6.75% 23-01.05.31	6.750	01.05.31	USD	175 000	225 000	-	400 000	402 774.00	0.24
Civitas 8.625% 23-01.11.30 144A	8.625	01.11.30	USD	-	125 000	-	125 000	134 238.63	0.08
Civitas Res 8.375% 01.07.28 144A	8.375	01.07.28	USD	150 000	200 000	-	350 000	367 158.05	0.22
Civitas Res 8.75% 01.07.31 144A	8.750	01.07.31	USD	75 000	-	-	75 000	80 420.18	0.05
Clarivate 4.875% 21-01.07.29 144A	4.875	01.07.29	USD	725 000	125 000	-	850 000	789 622.29	0.47
Clearwat	5.375	01.02.25	USD	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Clearwat 4.75% 20-15.08.28	4.750	15.08.28	USD	-	200 000	-	200 000	185 259.12	0.11
Cleveland 4.625% 21-01.03.29 144A	4.625	01.03.29	USD	425 000	-	-	425 000	402 877.14	0.24
Cleveland 7% 24-15.03.32 144A	7.000	15.03.32	USD	-	325 000	-	325 000	321 589.87	0.19
Clydesdale 8.75% 22-15.04.30 -144A	8.750	15.04.30	USD	2 075 000	-	-450 000	1 625 000	1 592 659.41	0.95
Cm New Hold 6.75% 19-01.07.26	6.750	01.07.26	USD	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Cmp Cmfc 7.375% 23-01.02.31 144A	7.375	01.02.31	USD	300 000	-	-	300 000	313 314.60	0.19
Cndo M 7.375% 22-15.02.30 144A	7.375	15.02.30	USD	1 800 000	-	-125 000	1 675 000	1 548 876.86	0.93
Cnx Mdstm 4.75% 21-15.04.30	4.750	15.04.30	USD	400 000	-	-	400 000	360 713.80	0.22
Coeur Minin 5.125% 21-15.02.29	5.125	15.02.29	USD	525 000	-	-	525 000	492 712.82	0.29
Colt Merger Sub 6.25% 1.07.25 144A	6.250	01.07.25	USD	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Colt Merger Sub 8.125% 1.07.27 144A	8.125	01.07.27	USD	675 000	-	-	675 000	689 176.35	0.41
Comstock Re 6.75% 21-01.03.29	6.750	01.03.29	USD	700 000	50 000	-150 000	600 000	581 971.20	0.35
Con 6.875% 15.07.32 144A Escrow	6.875	15.07.32	USD	-	125 000	-	125 000	126 813.46	0.08
Consensus 6.0% 21-15.10.26 144A	6.000	15.10.26	USD	375 000	-	-	375 000	366 163.13	0.22
Consensus 6.50% 21-15.10.28 144A	6.500	15.10.28	USD	575 000	-	-	575 000	537 667.95	0.32
Cornerstone 6.125% 20-15.01.29 144A	6.125	15.01.29	USD	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Cougar Jv 8% 24-15.05.32 144A	8.000	15.05.32	USD	-	50 000	-50 000	-	-	0.00
Cp Atlas Bu 7.0% 20-01.12.28 144A	7.000	01.12.28	USD	900 000	-	-150 000	750 000	642 593.70	0.38
Crrock 5.0% 21-01.05.29	5.000	01.05.29	USD	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Crrock 5.625% 17-15.10.25 144A	5.625	15.10.25	USD	825 000	-	-	825 000	823 598.08	0.49
Csc Hld 4.125% 20-01.12.30 144A	4.125	01.12.30	USD	900 000	-	-	900 000	582 600.87	0.35
Csc Hld 4.5% 21-15.11.31 144A	4.500	15.11.31	USD	375 000	-	-	375 000	242 243.58	0.14
Csc Hld 4.625% 20-01.12.30 144A	4.625	01.12.30	USD	400 000	-	-200 000	200 000	73 028.06	0.04
Csc Hld Inc 3.375% 15.02.31 144A	3.375	15.02.31	USD	200 000	-	-	200 000	124 900.10	0.07
Csc Hld Inc 5.0% 21-15.11.31	5.000	15.11.31	USD	300 000	-	-	300 000	109 003.16	0.07
Csc Hld Inc 5.75% 19-15.01.30	5.750	15.01.30	USD	1 225 000	-	-225 000	1 000 000	376 506.66	0.22
Csc Hldg	5.500	15.04.27	USD	825 000	-	-375 000	450 000	365 477.09	0.22
Dana Fin Lu 5.75% 17-15.04.25	5.750	15.04.25	USD	201 000	-	-	201 000	200 702.24	0.12
Dana Inc 4.50% 21-15.02.32	4.500	15.02.32	USD	175 000	-	-175 000	-	-	0.00
Diamond Bc 4.625% 21-01.10.29	4.625	01.10.29	USD	1 025 000	-	-1 025 000	-	-	0.00
Diamond Spo 5.375% 15.08.26 Regs	5.375	15.08.26	USD	225 000	-	-225 000	-	-	0.00
Directv 5.875% 21-15.08.27	5.875	15.08.27	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Dish Dbs	7.750	01.07.26	USD	300 000	-	-	300 000	186 668.15	0.11
Dish Dbs 5.125% 21-01.06.29	5.125	01.06.29	USD	1 100 000	-	-	1 100 000	436 578.01	0.26
Dish Dbs 5.75% 21-01.12.28	5.750	01.12.28	USD	125 000	-	-	125 000	86 945.23	0.05
Dish Dbs 7.375% 20-01.07.28	7.375	01.07.28	USD	300 000	-	-	300 000	127 917.00	0.08
Dish Netwrk 11.75% 22-15.11.27	11.750	15.11.27	USD	350 000	-	-350 000	-	-	0.00
Dornoch Deb 6.625% 21-15.10.29	6.625	15.10.29	USD	1 075 000	-	-275 000	800 000	682 107.36	0.41
Dt Midstrea 4.375% 21-15.06.31	4.375	15.06.31	USD	275 000	-	-	275 000	250 606.62	0.15
Dun Brads 5.0% 21-15.12.29 144A	5.000	15.12.29	USD	250 000	225 000	-	475 000	441 492.84	0.26
Edgewell Pe 4.125% 21-01.04.29	4.125	01.04.29	USD	400 000	-	-	400 000	368 468.56	0.22
Elastic 4.125% 21-15.07.29	4.125	15.07.29	USD	650 000	-	-	650 000	594 487.40	0.36
Eldorado 6.5% 24-15.02.32 144A	6.500	15.02.32	USD	-	125 000	-	125 000	125 702.38	0.08

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Bond - USD High Yield (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Eldorado 7.0% 23-15.02.30	7.000	15.02.30	USD	225 000	-	-	225 000	230 016.38	0.14
Elem Sol 3.875% 20-01.09.28 144A	3.875	01.09.28	USD	350 000	-	-	350 000	321 991.43	0.19
Embecta 6.75% 22-15.02.30 144A	6.750	15.02.30	USD	275 000	-	-50 000	225 000	196 792.29	0.12
Embecta Cor 5.0% 22-15.02.30	5.000	15.02.30	USD	150 000	-	-	150 000	123 675.00	0.07
Emerald Deb 6.625% 23-15.12.30	6.625	15.12.30	USD	800 000	200 000	-	1 000 000	1 010 284.00	0.60
Emrld Bo 6.75% 24-15.07.31 144A	6.750	15.07.31	USD	-	75 000	-	75 000	76 097.63	0.05
Energizer 4.375% 20-31.03.29	4.375	31.03.29	USD	500 000	-	-	500 000	452 802.40	0.27
Energizer 4.75% 20-15.06.28	4.750	15.06.28	USD	600 000	-	-	600 000	562 325.70	0.34
Energizer 6.50% 22-31.12.27	6.500	31.12.27	USD	175 000	-	-	175 000	174 968.64	0.10
Entegris 4.75% 22-15.04.29 144A	4.750	15.04.29	USD	-	200 000	-	200 000	191 529.76	0.11
Entegris 5.95% 15.06.30 144A	5.950	15.06.30	USD	550 000	150 000	-	700 000	693 835.38	0.41
Enviva 6.50% 19-15.01.26 144A	6.500	15.01.26	USD	1 025 000	-	-522 000	503 000	226 544.10	0.14
Eqd Mdstm 4.50% 21-15.01.29	4.500	15.01.29	USD	325 000	-	-	325 000	307 014.47	0.18
Eqd Mdstm 4.75% 21-15.01.31	4.750	15.01.31	USD	475 000	-	-125 000	350 000	327 517.12	0.20
Eqd Mdstm 6.0% 20-01.07.25	6.000	01.07.25	USD	92 000	-	-	92 000	92 068.08	0.05
Eqd Mdstm 6.375% 24-01.04.29	6.375	01.04.29	USD	-	50 000	-	50 000	50 535.80	0.03
Eqd Mdstm 6.50% 20-01.07.27	6.500	01.07.27	USD	550 000	-	-	550 000	556 218.85	0.33
Eqd Mdstm 7.50% 22-01.06.27	7.500	01.06.27	USD	125 000	-	-	125 000	127 733.00	0.08
Fortress In 7.5% 24-01.06.31	7.500	01.06.31	USD	-	175 000	-	175 000	179 515.00	0.11
Found 6.0% 21-01.03.29	6.000	01.03.29	USD	1 050 000	-	-25 000	1 025 000	910 896.49	0.54
Gap Inc 3.625% 21-01.10.29	3.625	01.10.29	USD	375 000	-	-75 000	300 000	259 910.70	0.16
Gap Inc 3.875% 21-01.10.31	3.875	01.10.31	USD	150 000	-	-75 000	75 000	62 673.89	0.04
Garda Ws 6.0% 21-01.06.29 144A	6.000	01.06.29	USD	650 000	-	-	650 000	593 672.04	0.35
Garda Ws 7.75% 23-15.02.28	7.750	15.02.28	USD	75 000	-	-	75 000	76 506.90	0.05
Garden Spin 8.625% 22-20.07.30	8.625	20.07.30	USD	125 000	-	-	125 000	135 258.63	0.08
Gartner Inc 4.50% 20-01.07.28	4.500	01.07.28	USD	150 000	-	-150 000	-	-	0.00
Gates Corp 6.875% 24-01.07.29	6.875	01.07.29	USD	-	200 000	-	200 000	203 764.00	0.12
Gates Glob 6.25% 19-15.01.26	6.250	15.01.26	USD	1 300 000	-	-1 300 000	-	-	0.00
Glb Med Res 6.50% 20-01.10.25	6.500	01.10.25	USD	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Go Daddy Op 5.25% 19-01.12.27	5.250	01.12.27	USD	525 000	-	-	525 000	514 360.72	0.31
Goto Group 5.5% 01.05.28 144A	5.500	01.05.28	USD	-	194 040	-	194 040	153 831.03	0.09
Goto Group 5.5% 01.05.28 144A	5.500	01.05.28	USD	-	267 960	-	267 960	108 523.80	0.06
Graphic Pac 3.75% 21-01.02.30	3.750	01.02.30	USD	75 000	-	-	75 000	67 119.77	0.04
Gray 4.75% 20-15.10.30 144A	4.750	15.10.30	USD	175 000	-	-100 000	75 000	45 082.84	0.03
Gray Escrow 5.375% 21-15.11.31	5.375	15.11.31	USD	650 000	-	-225 000	425 000	241 403.14	0.14
Gray Tel Ic	5.875	15.07.26	USD	775 000	-	-775 000	-	-	0.00
Gtcr Ap Fin 8% 19-15.05.27 144A	8.000	15.05.27	USD	1 100 000	-	-175 000	925 000	927 900.80	0.55
Gtcr W-2 7.5% 23-15.01.31 144A	7.500	15.01.31	USD	-	700 000	-	700 000	730 516.43	0.44
Gw B-Cr 9.50% 19-01.11.27	9.500	01.11.27	USD	1 495 000	-	-350 000	1 145 000	1 151 417.73	0.69
Gyp Hldgs I 4.625% 21-01.05.29	4.625	01.05.29	USD	400 000	-	-	400 000	370 728.60	0.22
H&E Equip 3.875% 15.12.28 144A	3.875	15.12.28	USD	750 000	-	-225 000	525 000	474 605.15	0.28
Hb Fuller 4.25% 20-15.10.28	4.250	15.10.28	USD	150 000	-	-	150 000	142 175.21	0.08
Healtheq 4.50% 01.10.29 144A	4.500	01.10.29	USD	675 000	-	-	675 000	631 813.03	0.38
Helios Soft 4.625% 21-01.05.28 144A	4.625	01.05.28	USD	525 000	50 000	-275 000	300 000	268 289.64	0.16
Herens Hold 4.75% 15.05.28 144A	4.750	15.05.28	USD	875 000	-	-125 000	750 000	651 540.00	0.39
Hess Midstr 4.25% 21-15.02.30	4.250	15.02.30	USD	250 000	-	-	250 000	229 599.25	0.14
Hess Midstr 5.125% 19-15.06.28	5.125	15.06.28	USD	350 000	-	-	350 000	339 149.51	0.20
Hess Midstr 6.5% 24-01.06.29	6.500	01.06.29	USD	-	75 000	-	75 000	76 086.30	0.05
Hilton Dome 4.875% 19-15.01.30	4.875	15.01.30	USD	175 000	-	-	175 000	167 654.90	0.10
Hilton Dome 5.75% 20-01.05.28	5.750	01.05.28	USD	350 000	-	-	350 000	348 493.36	0.21
Holly 6.375% 22-15.04.27 144A	6.375	15.04.27	USD	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Holly En 5.0% 20-01.02.28	5.000	01.02.28	USD	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Hub Inter 5.625% 21-01.12.29	5.625	01.12.29	USD	900 000	-	-	900 000	851 976.72	0.51
Hub Inter 7% 18-01.05.26 144A	7.000	01.05.26	USD	2 475 000	-	-2 475 000	-	-	0.00
Hub Inter 7.25% 23-15.06.30	7.250	15.06.30	USD	275 000	550 000	-	825 000	846 192.60	0.51
Hub Inter 7.375% 31.01.32 144A	7.375	31.01.32	USD	-	950 000	-	950 000	963 876.65	0.58
Iheartcomm 4.75% 19-15.01.28	4.750	15.01.28	USD	250 000	-	-100 000	150 000	77 126.71	0.05
Iheartcomm 5.25% 15.08.27 144A	5.250	15.08.27	USD	125 000	-	-	125 000	66 510.56	0.04

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Bond - USD High Yield (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Iho Ver 6.375% 15.05.29 /Pik	6.375	15.05.29	USD	300 000	100 000	-200 000	200 000	197 697.98	0.12
Ii-Vi Inc 5% 21-15.12.29 144A	5.000	15.12.29	USD	675 000	-	-	675 000	639 481.91	0.38
Ims Health	5.000	15.10.26	USD	425 000	-	-	425 000	417 399.77	0.25
Insight 6.625% 24-15.05.32 144A	6.625	15.05.32	USD	-	150 000	-	150 000	152 477.85	0.09
Interface 5.50% 20-01.12.28	5.500	01.12.28	USD	325 000	50 000	-	375 000	353 559.66	0.21
Iron 7.0% 23-15.02.29	7.000	15.02.29	USD	425 000	100 000	-	525 000	534 802.28	0.32
Jazz 4.375% 21-15.01.29 144A	4.375	15.01.29	USD	475 000	-	-175 000	300 000	278 761.98	0.17
Jb Poin 8.75% 23-15.12.31 144A	8.750	15.12.31	USD	-	300 000	-	300 000	311 198.40	0.19
Jones 10.50% 22-15.12.30	10.500	15.12.30	USD	475 000	-	-	475 000	510 494.85	0.30
Jones 8.50% 23-15.03.30 144A	8.500	15.03.30	USD	500 000	-	-	500 000	523 249.00	0.31
Kar Auct 5.125% 17-01.06.25 144A	5.125	01.06.25	USD	77 000	-	-77 000	-	-	0.00
Kfc Pizza 4.75% 17-01.06.27	4.750	01.06.27	USD	575 000	-	-	575 000	561 395.44	0.34
Kodiak 7.25% 24-15.02.29	7.250	15.02.29	USD	-	300 000	-	300 000	307 782.30	0.18
Kontoor 4.125% 21-15.11.29	4.125	15.11.29	USD	175 000	-	-	175 000	158 610.38	0.09
Lamar Media 3.625% 21-15.01.31	3.625	15.01.31	USD	125 000	-	-	125 000	110 221.25	0.07
Lamar Media 4.875% 20-15.01.29	4.875	15.01.29	USD	150 000	-	-	150 000	144 315.42	0.09
Lcm Investm 4.875% 01.05.29 144A	4.875	01.05.29	USD	-	150 000	-	150 000	140 456.09	0.08
Lcm Investm 8.25% 23-01.08.31	8.250	01.08.31	USD	-	500 000	-	500 000	522 771.00	0.31
Lender Pro 3.625% 20-01.09.28	3.625	01.09.28	USD	475 000	-	-475 000	-	-	0.00
Lifepoint 6.75% 20-15.04.25 144A	6.750	15.04.25	USD	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Lifepoint 9.75% 18-01.12.26	9.750	01.12.26	USD	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
Light Wonde 7.5% 01.09.31 144A	7.500	01.09.31	USD	-	250 000	-	250 000	258 461.00	0.15
Logan Merge 5.50% 20-01.09.27 144A	5.500	01.09.27	USD	925 000	-	-925 000	-	-	0.00
Macquarie 6.5% 24-26.03.31 144A	6.500	26.03.31	USD	-	50 000	-	50 000	51 474.85	0.03
Macquarie A 6.4% 24-26.03.29	6.400	26.03.29	USD	-	50 000	-	50 000	50 893.95	0.03
Madison IaQ 5.875% 21-30.06.29	5.875	30.06.29	USD	1 525 000	-	-350 000	1 175 000	1 094 104.19	0.65
Masterbrand 7% 24-15.07.32 144A	7.000	15.07.32	USD	-	100 000	-	100 000	101 227.10	0.06
Matador Res 6.5% 24-15.04.32	6.500	15.04.32	USD	-	225 000	-	225 000	225 276.98	0.13
Match 4.125% 20-01.08.30 144A	4.125	01.08.30	USD	350 000	-	-	350 000	310 115.79	0.19
Match 4.625% 20-01.06.28 144A	4.625	01.06.28	USD	150 000	-	-150 000	-	-	0.00
Match Group 5% 17-15.12.27 144A	5.000	15.12.27	USD	450 000	-	-	450 000	431 706.65	0.26
Match Grp H 3.625% 21-01.10.31	3.625	01.10.31	USD	350 000	-	-	350 000	296 801.68	0.18
Mauser 7.875% 15.04.27 144A	7.875	15.04.27	USD	-	325 000	-	325 000	332 068.75	0.20
Mauser 9.25% 23-15.04.27 144A	9.250	15.04.27	USD	375 000	-	-	375 000	375 690.38	0.22
Medline Bor 6.25% 01.04.29 144A	6.250	01.04.29	USD	-	225 000	-	225 000	227 944.04	0.14
Midas 5.625% 21-15.08.29 144A	5.625	15.08.29	USD	1 075 000	125 000	-	1 200 000	1 110 969.12	0.66
Midwest Gam 4.875% 21-01.05.29	4.875	01.05.29	USD	375 000	-	-	375 000	349 543.03	0.21
Millenniu 6.625% 21-01.08.26 144A	6.625	01.08.26	USD	350 000	-	-	350 000	183 915.41	0.11
Minerva Mer 6.50% 22-15.02.30	6.500	15.02.30	USD	1 825 000	-	-250 000	1 575 000	1 451 229.57	0.87
Mitr Brdn / 6.75% 24-01.04.32	6.750	01.04.32	USD	-	225 000	-	225 000	226 783.35	0.14
Miwd Hld /Mi 5.50% 22-01.02.30	5.500	01.02.30	USD	100 000	-	-	100 000	92 537.27	0.06
Moheg Gam 8.0% 21-01.02.26	8.000	01.02.26	USD	1 025 000	-	-275 000	750 000	711 768.75	0.43
Mozart Debt 3.875% 21-01.04.29	3.875	01.04.29	USD	500 000	-	-200 000	300 000	276 471.03	0.17
Mozart Debt 5.25% 21-01.10.29	5.250	01.10.29	USD	1 800 000	-	-175 000	1 625 000	1 552 086.09	0.93
Mph Merger	5.750	01.11.28	USD	175 000	-	-175 000	-	-	0.00
Nabors Ind 7.25% 20-15.01.26 144A	7.250	15.01.26	USD	350 000	-	-100 000	250 000	253 860.50	0.15
Nabors Ind 7.375% 21-15.05.27	7.375	15.05.27	USD	50 000	-	-	50 000	50 877.40	0.03
Nabors Ind 7.50% 20-15.01.28 144A	7.500	15.01.28	USD	150 000	-	-	150 000	143 270.84	0.09
Nabors Ind 9.125% 23-31.01.30 144A	9.125	31.01.30	USD	-	75 000	-	75 000	77 767.21	0.05
Nationl Fin 6.875% 20-15.08.28	6.875	15.08.28	USD	1 925 000	-	-1 925 000	-	-	0.00
Nationl Fin 7.50% 22-01.10.30	7.500	01.10.30	USD	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Ncl 5.875% 20-15.03.26 144A	5.875	15.03.26	USD	-	225 000	-	225 000	222 621.89	0.13
Ncl 7.75% 22-15.02.29	7.750	15.02.29	USD	-	125 000	-	125 000	130 030.63	0.08
Ncl 8.125% 23-15.01.29 144A	8.125	15.01.29	USD	-	250 000	-	250 000	262 434.58	0.16
Ncl Finance 6.125% 21-15.03.28	6.125	15.03.28	USD	-	200 000	-	200 000	197 707.64	0.12
Ncr Atleos 9.5% 23-01.04.29 144A	9.500	01.04.29	USD	-	350 000	-50 000	300 000	324 480.90	0.19
Ncr Corp 5.0% 20-01.10.28	5.000	01.10.28	USD	250 000	-	-	250 000	236 238.03	0.14
Ncr Corp 5.125% 21-15.04.29 144A	5.125	15.04.29	USD	300 000	200 000	-	500 000	471 543.55	0.28

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Bond - USD High Yield (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Ncr Corp 5.25% 20-01.10.30	5.250	01.10.30	USD	325 000	-	-75 000	250 000	228 734.70	0.14
Ncr Corp 5.75% 19-01.09.27 144A	5.750	01.09.27	USD	375 000	-	-375 000	-	-	0.00
Ncr Corp 6.125% 19-01.09.29 144A	6.125	01.09.29	USD	150 000	-	-150 000	-	-	0.00
Nexstar 5.625% 19-15.07.27 144A	5.625	15.07.27	USD	925 000	-	-225 000	700 000	665 577.64	0.40
Nexstar Bro 4.75% 20-01.11.28	4.750	01.11.28	USD	175 000	-	-175 000	-	-	0.00
Nrg Energy 3.875% 15.02.32	3.875	15.02.32	USD	600 000	-	-546 000	54 000	46 439.87	0.03
Nrg Energy 6.625% 17-15.01.27	6.625	15.01.27	USD	122 000	-	-	122 000	121 843.55	0.07
Nthriv Mids 6.75% 24-15.07.32	6.750	15.07.32	USD	-	200 000	-	200 000	200 671.00	0.12
Nxtera Oper 7.25% 23-15.01.29	7.250	15.01.29	USD	-	475 000	-	475 000	487 548.55	0.29
Oasis Midst 8.0% 01.04.29 144A	8.000	01.04.29	USD	350 000	-	-350 000	-	-	0.00
Oasis Ptrlm 6.375% 01.06.26 144A	6.375	01.06.26	USD	100 000	-	-	100 000	100 068.90	0.06
Oi European 4.75% 15.02.30 144A	4.750	15.02.30	USD	450 000	-	-	450 000	411 927.03	0.25
Olympus Wat 4.25% 21-01.10.28	4.250	01.10.28	USD	425 000	-	-	425 000	387 320.27	0.23
Olympus Wat 6.25% 21-01.10.29	6.250	01.10.29	USD	575 000	-	-	575 000	525 522.29	0.31
Olympus Wat 9.75% 23-15.11.28	9.750	15.11.28	USD	325 000	75 000	-	400 000	424 523.60	0.25
Onex Usi 7.5% 23-15.01.32	7.500	15.01.32	USD	-	1 025 000	-	1 025 000	1 042 316.35	0.62
Ontario Gam 8% 23-01.08.30	8.000	01.08.30	USD	-	450 000	-	450 000	462 161.25	0.28
Open 4.125% 21-01.12.31 144A	4.125	01.12.31	USD	525 000	-	-	525 000	462 495.81	0.28
Open Text 3.875% 20-15.02.28 144A	3.875	15.02.28	USD	100 000	-	-	100 000	92 656.64	0.06
Open Text 6.90% 22-01.12.27	6.900	01.12.27	USD	175 000	-	-	175 000	181 860.53	0.11
Organon & C 6.75% 24-15.05.34	6.750	15.05.34	USD	-	250 000	-	250 000	249 936.03	0.15
Organon 4.125% 21-30.04.28 144A	4.125	30.04.28	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Organon Fin 5.125% 21-30.04.31	5.125	30.04.31	USD	550 000	-	-	550 000	493 371.12	0.29
Outfrnt Md 4.25% 21-15.01.29 144A	4.250	15.01.29	USD	125 000	-	-	125 000	114 133.34	0.07
Ow Br 7.25% 23-15.05.31 144A	7.250	15.05.31	USD	375 000	-	-	375 000	374 698.05	0.22
Ow-Br Glis	6.375	15.08.25	USD	50 000	-	-50 000	-	-	0.00
Ow-Br Glis 6.625% 20-13.05.27 144A	6.625	13.05.27	USD	169 000	-	-	169 000	168 869.52	0.10
Panther Bf 8.5% 19-15.05.27 144A	8.500	15.05.27	USD	2 125 000	-	-375 000	1 750 000	1 762 748.58	1.05
Panther Esc 7.125% 24-01.06.31	7.125	01.06.31	USD	-	775 000	-	775 000	784 394.55	0.47
Pdc Energy 5.75% 18-15.05.26	5.750	15.05.26	USD	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Pdc Energy 6.125% 17-15.09.24	6.125	15.09.24	USD	87 000	-	-87 000	-	-	0.00
Penn 4.125% 21-01.07.29	4.125	01.07.29	USD	350 000	100 000	-	450 000	386 508.02	0.23
Penn 5.625% 17-15.01.27 144A	5.625	15.01.27	USD	50 000	75 000	-	125 000	120 761.79	0.07
Perf Food G 4.25% 21-01.08.29	4.250	01.08.29	USD	350 000	-	-	350 000	318 882.76	0.19
Polar Us Bo 6.75% 21-15.05.26	6.750	15.05.26	USD	425 000	-	-425 000	-	-	0.00
Post Hl 5.625% 17-15.01.28 144A	5.625	15.01.28	USD	325 000	-	-	325 000	320 230.08	0.19
Post Hldg 5.5% 19-15.12.29	5.500	15.12.29	USD	200 000	-	-	200 000	193 132.10	0.12
Post Hldg 5.75% 17-01.03.27 144A	5.750	01.03.27	USD	433 000	-	-433 000	-	-	0.00
Post Hldg 6.25% 24-15.02.32 144A	6.250	15.02.32	USD	-	150 000	-	150 000	150 386.10	0.09
Precisn 6.875% 21-15.01.29	6.875	15.01.29	USD	450 000	75 000	-225 000	300 000	297 018.42	0.18
Precisn 7.125% 17-15.01.26 144A	7.125	15.01.26	USD	75 000	-	-22 000	53 000	53 193.82	0.03
Quicken Loa 3.625% 20-01.03.29	3.625	01.03.29	USD	250 000	-	-	250 000	227 031.73	0.14
Quicken Loa 3.875% 20-01.03.31	3.875	01.03.31	USD	650 000	-	-225 000	425 000	371 359.99	0.22
Quintiles 5% 19-15.05.27 144A	5.000	15.05.27	USD	200 000	-	-	200 000	195 334.98	0.12
Racksp Host 3.50% 21-15.02.28	3.500	15.02.28	USD	550 000	-	-550 000	-	-	0.00
Racksp Host 5.375% 20-01.12.28	5.375	01.12.28	USD	650 000	-	-650 000	-	-	0.00
Rackspace 3.5% 24-15.05.28	3.500	15.05.28	USD	-	385 000	-100 000	285 000	122 906.25	0.07
Range Resou 4.75% 22-15.02.30	4.750	15.02.30	USD	75 000	-	-	75 000	70 428.53	0.04
Range Resou 8.25% 21-15.01.29	8.250	15.01.29	USD	225 000	-	-	225 000	233 353.35	0.14
Raptor Acqn 4.875% 21-01.11.26	4.875	01.11.26	USD	225 000	-	-	225 000	218 062.80	0.13
Redwood 8.75% 22-1.04.30 144A	8.750	01.04.30	USD	825 000	-	-50 000	775 000	796 621.73	0.48
Regional 5.375% 20-15.01.29	5.375	15.01.29	USD	525 000	-	-425 000	100 000	87 983.01	0.05
Rhp 6.5% 24-01.04.32	6.500	01.04.32	USD	-	175 000	-	175 000	175 408.45	0.10
Rhp 7.25% 23-15.07.28	7.250	15.07.28	USD	100 000	-	-	100 000	103 496.40	0.06
Ritchie Bro 6.75% 15.03.28 144A	6.750	15.03.28	USD	125 000	-	-125 000	-	-	0.00
Ritchie Bro 7.75% 15.03.31 144A	7.750	15.03.31	USD	100 000	-	-100 000	-	-	0.00
RI Hero Mrg 6.25% 21-01.02.29	6.250	01.02.29	USD	900 000	-	-100 000	800 000	686 636.40	0.41
Roblox 3.875% 21-01.05.30	3.875	01.05.30	USD	425 000	-	-	425 000	377 957.30	0.23

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Bond - USD High Yield (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Rockcliff E 5.50% 15.10.29 144A	5.500	15.10.29	USD	300 000	-	-	300 000	281 044.37	0.17
Rocket Mort 2.875% 21-15.10.26	2.875	15.10.26	USD	450 000	-	-	450 000	420 594.53	0.25
Rocket Mort 4.0% 15.10.33 144A	4.000	15.10.33	USD	350 000	-	-	350 000	295 279.43	0.18
Rocket Soft 6.50% 21-15.02.29	6.500	15.02.29	USD	1 025 000	-	-	1 025 000	894 688.98	0.53
Rocket Soft 9% 24-28.11.28	9.000	28.11.28	USD	-	75 000	-	75 000	76 292.10	0.05
Royal 5.375% 22-15.07.27 144A	5.375	15.07.27	USD	-	250 000	-	250 000	246 369.23	0.15
Royal 5.50% 21-31.08.26 144A	5.500	31.08.26	USD	-	75 000	-	75 000	74 205.28	0.04
Royal Carib 6.25% 15.03.32 144A	6.250	15.03.32	USD	-	250 000	-	250 000	252 261.05	0.15
Ryan Specia 4.375% 22-01.02.30	4.375	01.02.30	USD	300 000	-	-	300 000	278 230.14	0.17
Sc Games HI 6.625% 22-01.03.30	6.625	01.03.30	USD	525 000	-	-	525 000	512 204.75	0.31
Sci Games 7.25% 19-15.11.29	7.250	15.11.29	USD	200 000	75 000	-200 000	75 000	76 669.05	0.05
Sci Games 8.625% 20-01.07.25	8.625	01.07.25	USD	575 000	-	-575 000	-	-	0.00
Science App 4.875% 20-01.04.28	4.875	01.04.28	USD	125 000	-	-	125 000	119 414.63	0.07
Scripps Esc 5.375% 15.01.31 144A	5.375	15.01.31	USD	175 000	-	-175 000	-	-	0.00
Scripps Esc 5.875% 15.07.27 144A	5.875	15.07.27	USD	400 000	-	-	400 000	239 623.03	0.14
Seagate Hdd 8.5% 23-15.07.31	8.500	15.07.31	USD	-	200 000	-	200 000	215 569.40	0.13
Seagate Hdd 8.50% 23-15.07.31	8.500	15.07.31	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Seagate Hdd 9.625% 22-01.12.32	9.625	01.12.32	USD	-	666 625	-50 000	616 625	703 831.19	0.42
Sealed Air 4.0% 19-01.12.27	4.000	01.12.27	USD	325 000	-	-	325 000	305 921.75	0.18
Sealed Air 6.125% 23-01.02.28	6.125	01.02.28	USD	100 000	-	-	100 000	99 869.07	0.06
Sealed Air 6.5% 24-15.07.32	6.500	15.07.32	USD	-	150 000	-	150 000	149 465.37	0.09
Seaworld Pa 5.25% 21-15.08.29	5.250	15.08.29	USD	900 000	-	-175 000	725 000	685 324.74	0.41
Sensata 4.375% 19-15.02.30 144A	4.375	15.02.30	USD	175 000	-	-	175 000	160 903.35	0.10
Sensata 5.875% 22-01.09.30 144A	5.875	01.09.30	USD	200 000	-	-	200 000	196 022.44	0.12
Sensata Te 6.625% 15.07.32 144A	6.625	15.07.32	USD	-	200 000	-	200 000	201 565.60	0.12
Sensata Tec 3.75% 20-15.02.31	3.750	15.02.31	USD	75 000	-	-	75 000	65 358.37	0.04
Signal Pare 6.125% 21-01.04.29	6.125	01.04.29	USD	275 000	-	-275 000	-	-	0.00
Sinclair	5.125	15.02.27	USD	525 000	-	-250 000	275 000	243 644.50	0.15
Sinclair 5.5% 19-01.03.30	5.500	01.03.30	USD	550 000	-	-225 000	325 000	192 039.25	0.11
Sirius Xm 3.125% 21-01.09.26	3.125	01.09.26	USD	350 000	-	-	350 000	329 617.12	0.20
Sirius Xm 3.875% 21-01.09.31	3.875	01.09.31	USD	825 000	-	-	825 000	673 923.77	0.40
Sirius Xm 4.0% 21-15.07.28	4.000	15.07.28	USD	300 000	-	-	300 000	271 268.70	0.16
Sirius Xm 4.125% 20-01.07.30	4.125	01.07.30	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Sirius Xm 5.50% 19-01.07.29	5.500	01.07.29	USD	250 000	-	-	250 000	235 048.68	0.14
Sitio Roy / 7.875% 23-01.11.28	7.875	01.11.28	USD	-	150 000	-	150 000	155 226.30	0.09
Six Flags E 7.25% 23-15.05.31	7.250	15.05.31	USD	350 000	125 000	-	475 000	483 956.13	0.29
Sm Energy 6.625% 18-15.01.27	6.625	15.01.27	USD	75 000	-	-75 000	-	-	0.00
Solaris Mid 7.625% 21-01.04.26	7.625	01.04.26	USD	250 000	-	-	250 000	251 175.75	0.15
Srs Distrib 6.0% 21-01.12.29	6.000	01.12.29	USD	925 000	-	-925 000	-	-	0.00
Srs Distrib 6.125% 01.07.29 144A	6.125	01.07.29	USD	675 000	-	-675 000	-	-	0.00
Ss&C Tech I 5.5% 19-30.09.27 144A	5.500	30.09.27	USD	900 000	75 000	-	975 000	960 766.95	0.57
Ss&C Tech I 6.5% 24-01.06.32	6.500	01.06.32	USD	-	200 000	-	200 000	202 098.80	0.12
Stand Ind 5% 17-15.02.27 144A	5.000	15.02.27	USD	1 150 000	-	-	1 150 000	1 119 252.11	0.67
Standard In 3.375% 20-15.01.31	3.375	15.01.31	USD	300 000	-	-	300 000	253 092.36	0.15
Standard In 4.375% 20-15.07.30	4.375	15.07.30	USD	175 000	-	-175 000	-	-	0.00
Station 4.50% 20-15.02.28	4.500	15.02.28	USD	300 000	-	-	300 000	282 558.78	0.17
Station 4.625% 21-01.12.31	4.625	01.12.31	USD	400 000	-	-	400 000	356 902.44	0.21
Station 6.625% 24-15.03.32	6.625	15.03.32	USD	-	75 000	-	75 000	74 694.75	0.04
Stena Intl 6.125% 20-01.02.25 144A	6.125	01.02.25	USD	425 000	-	-425 000	-	-	0.00
Stena Intl 7.25% 24-15.01.31 144A	7.250	15.01.31	USD	-	375 000	-	375 000	383 703.38	0.23
Sthwest En 8.375% 20-15.09.28	8.375	15.09.28	USD	275 000	-	-	275 000	284 533.70	0.17
Suburb Prop 5.0% 21-01.06.31 144A	5.000	01.06.31	USD	375 000	-	-	375 000	337 988.78	0.20
Suburb Prop 5.875% 17-01.03.27	5.875	01.03.27	USD	250 000	-	-	250 000	247 644.53	0.15
Summit Mid 5.75% 17-15.04.25	5.750	15.04.25	USD	325 000	-	-325 000	-	-	0.00
Synaptics 4.0% 21-15.06.29 144A	4.000	15.06.29	USD	150 000	75 000	-	225 000	204 263.57	0.12
Tap Rock 7.0% 21-01.10.26	7.000	01.10.26	USD	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Targa Res 5.50% 19-01.03.30	5.500	01.03.30	USD	300 000	-	-	300 000	298 474.56	0.18
Targa Res Par 6.5% 19-15.07.27	6.500	15.07.27	USD	250 000	-	-	250 000	251 801.75	0.15

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Bond - USD High Yield (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Tegna 4.625% 20-15.03.28	4.625	15.03.28	USD	75 000	-	-75 000	-	-	0.00
Tegna 5% 19-15.09.29	5.000	15.09.29	USD	900 000	-	-450 000	450 000	397 798.02	0.24
Telenet 5.5% 17-01.03.28	5.500	01.03.28	USD	1 200 000	-	-	1 200 000	1 140 817.64	0.68
Tenet Health 6.125% 01.10.28	6.125	01.10.28	USD	725 000	-	-100 000	625 000	622 279.31	0.37
Tenet Health 6.125% 22-15.06.30	6.125	15.06.30	USD	100 000	-	-	100 000	99 425.03	0.06
Tenet Health 6.25% 01.02.27	6.250	01.02.27	USD	375 000	-	-150 000	225 000	225 046.42	0.13
Tenet Hlthc 4.875% 23-01.01.26	4.875	01.01.26	USD	350 000	-	-350 000	-	-	0.00
Tenet Hlthc 5.125% 19-01.11.27	5.125	01.11.27	USD	425 000	-	-	425 000	416 297.28	0.25
Terraform 4.75% 19-15.01.30	4.750	15.01.30	USD	450 000	-	-	450 000	410 827.19	0.25
Terraform 5% 17-31.01.28 144A	5.000	31.01.28	USD	600 000	-	-	600 000	574 104.27	0.34
Terrier M B 8.875% 19-15.12.27	8.875	15.12.27	USD	1 350 000	-	-675 000	675 000	386 665.38	0.23
Tex Op 5.625% 19-15.02.27 144A	5.625	15.02.27	USD	350 000	-	-	350 000	344 346.59	0.21
Tibco 6.50% 22-31.03.29 144A	6.500	31.03.29	USD	850 000	-	-	850 000	815 764.74	0.49
Tibco Soft 8.25% 24-30.06.32	8.250	30.06.32	USD	-	100 000	-	100 000	101 988.10	0.06
Tibco Soft 9.0% 23-30.09.29	9.000	30.09.29	USD	425 000	100 000	-	525 000	509 766.13	0.30
Transalta 7.75% 22-15.11.29	7.750	15.11.29	USD	200 000	-	-	200 000	208 841.00	0.12
Transdigm 6.25% 19-15.03.26 144A	6.250	15.03.26	USD	975 000	-	-975 000	-	-	0.00
Transdigm 6.375% 01.03.29 144A	6.375	01.03.29	USD	-	425 000	-	425 000	427 673.34	0.26
Transdigm 6.625% 01.03.32 144A	6.625	01.03.32	USD	-	725 000	-	725 000	733 228.97	0.44
Transdigm 6.75% 15.08.28 144A	6.750	15.08.28	USD	200 000	-	-	200 000	202 691.20	0.12
Transdigm 6.875% 15.12.30 144A	6.875	15.12.30	USD	-	750 000	-	750 000	766 311.15	0.46
Transmontai 6.125% 18-15.02.26	6.125	15.02.26	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Trivium Pack 8.50% 15.08.27 144A	8.500	15.08.27	USD	1 200 000	75 000	-	1 275 000	1 266 802.64	0.76
Ttm Tech 4.0% 21-01.03.29	4.000	01.03.29	USD	400 000	-	-	400 000	367 192.08	0.22
Ultimate So 6.875% 24-01.02.31 144A	6.875	01.02.31	USD	-	725 000	-	725 000	734 582.33	0.44
United Rent 6.125% 24-15.03.34	6.125	15.03.34	USD	-	75 000	-	75 000	74 823.34	0.04
United Shor 5.50% 20-15.11.25	5.500	15.11.25	USD	800 000	-	-200 000	600 000	596 058.24	0.36
United Shor 5.50% 21-15.04.29	5.500	15.04.29	USD	700 000	-	-125 000	575 000	546 715.35	0.33
United Shor 5.75% 21-15.06.27	5.750	15.06.27	USD	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Univis 7.375% 22-30.06.30 144A	7.375	30.06.30	USD	325 000	-	-	325 000	302 542.66	0.18
Univision 4.5% 21-01.05.29 144A	4.500	01.05.29	USD	325 000	-	-	325 000	273 551.88	0.16
Univision 8% 23-15.08.28	8.000	15.08.28	USD	-	275 000	-	275 000	268 437.13	0.16
Upc Broad F 4.875% 21-15.07.31 144A	4.875	15.07.31	USD	1 175 000	-	-325 000	850 000	772 488.50	0.46
Urban One 7.375% 21-01.02.28 144A	7.375	01.02.28	USD	500 000	-	-350 000	150 000	116 867.93	0.07
Us Foods 4.625% 21-01.06.30	4.625	01.06.30	USD	125 000	-	-	125 000	116 232.53	0.07
Us Foods 4.75% 21-15.02.29	4.750	15.02.29	USD	725 000	-	-	725 000	688 233.08	0.41
Usa Compres 6.875% 19-01.09.27	6.875	01.09.27	USD	450 000	-	-	450 000	451 512.45	0.27
Usa Compres 7.125% 24-15.03.29	7.125	15.03.29	USD	-	400 000	-	400 000	403 375.60	0.24
Usagm Holdc 6.625% 19-15.07.26	6.625	15.07.26	USD	150 000	-	-145 000	5 000	4 989.32	0.00
Usis Me 6.875% 17-01.05.25 144A	6.875	01.05.25	USD	1 600 000	-	-1 600 000	-	-	0.00
Valeant 8.5% 18-31.01.27 144A	8.500	31.01.27	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Velocity Ve 8% 24-01.06.29	8.000	01.06.29	USD	-	100 000	-	100 000	102 821.50	0.06
Vertical Ho 7.625% 20-15.07.28 144A	7.625	15.07.28	USD	300 000	-	-300 000	-	-	0.00
Vertical Us 5.25% 20-15.07.27	5.250	15.07.27	USD	450 000	-	-450 000	-	-	0.00
Viavi Solut 3.75% 21-01.10.29	3.750	01.10.29	USD	100 000	100 000	-	200 000	169 204.12	0.10
Vici Prop 3.5% 20-15.02.25	3.500	15.02.25	USD	50 000	-	-	50 000	49 371.10	0.03
Vici Proper 4.625% 21-15.06.25 144A	4.625	15.06.25	USD	75 000	-	-	75 000	74 102.32	0.04
Vici Proper 5.625% 21-01.05.24 144A	5.625	01.05.24	USD	200 000	-	-200 000	-	-	0.00
Virgin Med 5% 20-15.07.30 144A	5.000	15.07.30	USD	600 000	-	-	600 000	495 381.01	0.30
Vistra Ope 5.5% 18-01.09.26 144A	5.500	01.09.26	USD	250 000	-	-	250 000	246 687.53	0.15
Vistra Oper 5% 19-31.07.27 144A	5.000	31.07.27	USD	225 000	-	-	225 000	217 810.64	0.13
Vistra Oper 6.875% 15.04.32 144A	6.875	15.04.32	USD	-	125 000	-	125 000	126 990.75	0.08
Vmed 4.50% 20-15.08.30 144A	4.500	15.08.30	USD	200 000	-	-	200 000	169 741.20	0.10
Vmed O2 Uk 4.25% 20-31.01.31	4.250	31.01.31	USD	200 000	-	-	200 000	166 404.74	0.10
Vmed O2 Uk 4.75% 15.07.31 144A	4.750	15.07.31	USD	575 000	-	-200 000	375 000	316 797.56	0.19
Vz Secured 5.0% 22-15.01.32	5.000	15.01.32	USD	250 000	-	-	250 000	213 486.57	0.13
Watco Comp 6.50% 20-15.06.27	6.500	15.06.27	USD	600 000	-	-	600 000	598 294.56	0.36
Wesco 7.125% 20-15.06.25 144A	7.125	15.06.25	USD	100 000	-	-100 000	-	-	0.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Bond - USD High Yield (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Wesco 7.25% 20-15.06.28 144A	7.250	15.06.28	USD	200 000	-	-	200 000	204 000.40	0.12
Wesco Dis 6.375% 15.03.29 144A	6.375	15.03.29	USD	-	250 000	-	250 000	251 231.75	0.15
Wesco Dis 6.625% 24-15.03.32	6.625	15.03.32	USD	-	275 000	-	275 000	278 305.23	0.17
Western Gas 4.05% 20-01.02.30	4.050	01.02.30	USD	125 000	-	-125 000	-	-	0.00
White Cap B 6.875% 20-15.10.28	6.875	15.10.28	USD	725 000	-	-	725 000	700 264.74	0.42
White Cap P 8.25% 15.03.26/Pik	8.250	15.03.26	USD	425 000	-	-	425 000	425 433.93	0.25
Wmg Acq 3.75% 21-01.12.29	3.750	01.12.29	USD	275 000	-	-	275 000	249 772.71	0.15
Wr Grace Ho 5.625% 21-15.08.29	5.625	15.08.29	USD	375 000	75 000	-75 000	375 000	346 186.88	0.21
Wr Grace Ho 7.375% 23-01.03.31	7.375	01.03.31	USD	150 000	-	-	150 000	152 226.90	0.09
Wynn Resort 7.125% 23-15.02.31	7.125	15.02.31	USD	-	225 000	-	225 000	233 711.84	0.14
Yum Brands 4.75% 19-15.01.30	4.750	15.01.30	USD	100 000	-	-	100 000	95 326.08	0.06
Zebra Te 6.5% 24-01.06.32 144A	6.500	01.06.32	USD	-	150 000	-	150 000	151 997.40	0.09
Zf Na Cap 6.875% 14.04.28 144A	6.875	14.04.28	USD	150 000	175 000	-	325 000	331 541.60	0.20
Zf Na Capit 7.125% 23-14.04.30	7.125	14.04.30	USD	150 000	-	-	150 000	155 409.15	0.09
Ziprecruite 5% 22-15.01.30 144A	5.000	15.01.30	USD	300 000	-	-	300 000	261 414.87	0.16
							136 188 494.95	81.39	
Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere							136 188 494.95	81.39	
				01.07.2023			Schlussbestand 30.06.2024	USD	
Sonstige übertragbare Wertpapiere									
Aktien									
Rights Intelsat Ja			USD	893	-	-893	-	-	0.00
									0.00
Anleihen									
Alnt Hldgs 7% 23-15.01.31	7.000	15.01.31	USD	-	450 000	-	450 000	455 579.10	0.27
Hf Inclair 5% 01.02.28 144A	5.000	01.02.28	USD	-	400 000	-	400 000	387 820.68	0.23
Hf Sin 6.375% 23-15.04.27 144A	6.375	15.04.27	USD	-	100 000	-	100 000	100 253.73	0.06
Illuminate 9.0% 20-01.07.28	9.000	01.07.28	USD	-	225 000	-	225 000	227 158.65	0.14
Int8. 5% 15.10.24 /Escrow Dflt144a	5.000	15.10.24	USD	275 000	-	-275 000	-	-	0.00
Intel 9.75% 15.07.25 /Escrow 144A	9.750	15.07.25	USD	200 000	200 000	-400 000	-	-	0.00
Intelsat Jacks 01.08.23 /Escrow	5.500	01.08.23	USD	425 000	425 000	-850 000	-	-	0.00
Sealed Air/ 7.25% 23-15.02.31	7.250	15.02.31	USD	-	125 000	-	125 000	128 977.13	0.08
Vistra Oper 7.75% 23-15.10.31	7.750	15.10.31	USD	-	100 000	-	100 000	104 187.60	0.06
							1 403 976.89	0.84	
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere							1 403 976.89	0.84	
SUMME WERTPAPIERBESTAND							160 188 857.27	95.73	
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen							5 369 015.24	3.21	
Sonstige Aktiven							1 778 090.65	1.06	
GESAMTNETTOVERMÖGEN							167 335 963.16	100.00	

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Total Return Global

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Anleihen									
10 Renew Pw 4.50% 21-14.07.28	4.500	14.07.28	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
7-Eleven In 1.80% 10.02.31 Regs	1.800	10.02.31	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 408 056.26	0.82
Abertis Fin 2.625% 21-Perp	2.625	31.12.99	EUR	3 000 000	-	-	3 000 000	3 018 697.75	1.03
Acciona Ene 5.125% 23-23.04.31	5.125	23.04.31	EUR	-	2 000 000	-	2 000 000	2 219 200.27	0.75
Alfa	6.875	25.03.44	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Alibaba Grp	3.600	28.11.24	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	991 941.41	0.34
Alibaba Grp 2.70% 21-09.02.41	2.700	09.02.41	USD	5 000 000	-	-4 000 000	1 000 000	675 308.77	0.23
Argentum Nethld 5.625% 16-15.08.52	5.625	15.08.52	USD	800 000	-	-	800 000	789 330.00	0.27
Australia 1% 19-21.12.30	1.000	21.12.30	AUD	40 000 000	-	-15 000 000	25 000 000	13 737 557.13	4.67
Australia 1.25% 19-21.05.32	1.250	21.05.32	AUD	19 700 000	-	-2 700 000	17 000 000	9 096 816.14	3.09
Australia 1.5% 21.11.31	1.500	21.11.31	AUD	40 000 000	-	-5 000 000	35 000 000	18 650 766.32	6.34
Australia 2.5% 18-21.05.30	2.500	21.05.30	AUD	-	8 000 000	-	8 000 000	4 894 764.92	1.66
Australia 2.75% 18-21.05.41	2.750	21.05.41	AUD	11 000 000	-	-11 000 000	-	-	0.00
Australia 3.75% 14-21.04.37	3.750	21.04.37	AUD	19 000 000	-	-6 000 000	13 000 000	8 128 269.35	2.76
Baidu Inc 1.72% 20-09.04.26	1.720	09.04.26	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Baidu Inc 2.375% 21-23.08.31	2.375	23.08.31	USD	4 000 000	-	-4 000 000	-	-	0.00
Ball Corp 2.875% 20-15.08.30	2.875	15.08.30	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Bharat Petr	4.000	08.05.25	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	987 010.00	0.34
Boardwalk 4.80% 19-03.05.29	4.800	03.05.29	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	979 435.95	0.33
Bpcm 3.25% 20-Perp	3.250	31.12.99	EUR	2 000 000	-	-	2 000 000	2 097 289.36	0.71
Bprl Intern 4.375% 17-18.01.27	4.375	18.01.27	USD	1 300 000	-	-1 300 000	-	-	0.00
Cat Pac Mtn 4.875% 21-17.08.26	4.875	17.08.26	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 965 900.00	0.67
Celanese Us 4.777% 22-19.07.26	4.777	19.07.26	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	1 087 081.38	0.37
Celanese Us 5.90% 22-05.07.24	5.900	05.07.24	USD	250 000	-	-250 000	-	-	0.00
Celanese Us 6.165% 22-15.07.27	6.165	15.07.27	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	1 015 545.00	0.34
Cellnex Fin 1.50% 21-08.06.28	1.500	08.06.28	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	986 158.17	0.34
Charter Com 3.50% 21-01.03.42	3.500	01.03.42	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Cloverie 5.625% 16-24.06.46	5.625	24.06.46	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	2 973 210.00	1.01
Cloverie Pl	4.500	11.09.44	USD	400 000	-	-	400 000	397 651.50	0.14
Colombia 3.125% 20-15.04.31	3.125	15.04.31	USD	4 000 000	-	-4 000 000	-	-	0.00
Colombia 8.125% 04-21.05.24	8.125	21.05.24	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Contnm E 4.5% 09.02.27/Pool Regs	4.500	09.02.27	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Cosan	8.250	29.11.49	USD	1 200 000	800 000	-	2 000 000	2 034 780.00	0.69
Count Gard 6.15% 19-17.09.25	6.150	17.09.25	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Crown Euro. 3.38% 15-15.05.25	3.380	15.05.25	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Cvs Health 4.875% 15-20.07.35	4.875	20.07.35	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Demeter Inv 4.625% 17-Perp	4.625	31.12.99	USD	2 300 000	-	-2 300 000	-	-	0.00
Deut Lufth 3.0% 20-29.05.26	3.000	29.05.26	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	1 054 368.43	0.36
Ebrd 0% 22-02.02.32	0.000	02.02.32	BRL	-	33 000 000	-	33 000 000	2 755 225.94	0.94
Elm For Fir 3.75% 20-Perp	3.750	31.12.99	EUR	2 000 000	-	-	2 000 000	2 121 312.10	0.72
Enel	8.750	24.09.73	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Eqtd Mdstm 4.125% 16-01.12.26	4.125	01.12.26	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 446 811.95	0.49
Eurofins 3.25% 17-Perp Regs	3.250	31.12.99	EUR	1 000 000	-	-	1 000 000	1 022 224.43	0.35
Fedex Corp 4.05% 18-15.02.48	4.050	15.02.48	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Frs Med Care 2.375% 16.02.31	2.375	16.02.31	USD	2 300 000	500 000	-	2 800 000	2 216 079.71	0.75
Greenko 3.85% 29.03.26 /Pool	3.850	29.03.26	USD	2 890 000	-	-1 300 000	1 590 000	1 366 853.15	0.46
Grupo Bimbo	3.875	27.06.24	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Hunt 6.375% 18-01.06.28 /Pool Regs	6.375	01.06.28	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Informa 2.125% 20-06.10.25	2.125	06.10.25	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Intl Bk Rec 0% 23-08.02.38	0.000	08.02.38	BRL	-	42 000 000	-10 000 000	32 000 000	1 471 743.89	0.50
Intl Bk Rec 5.0% 21-22.01.26	5.000	22.01.26	BRL	15 000 000	-	-15 000 000	-	-	0.00
Intl Bk Rec 5.75% 21-14.01.28	5.750	14.01.28	BRL	7 000 000	8 000 000	-	15 000 000	2 323 409.59	0.79
Intl Bk Rec 9.50% 22-09.02.29	9.500	09.02.29	BRL	12 500 000	-	-	12 500 000	2 174 272.27	0.74

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Total Return Global (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Intl Fin 0% 18-22.02.38	0.000	22.02.38	MXN	-	200 000 000	-	200 000 000	3 065 809.28	1.04
Intl Fin 6.5% 19-27.03.26	6.500	27.03.26	BRL	15 000 000	-	-	15 000 000	2 557 782.92	0.87
Intl Fin 6.75% 19-27.08.24	6.750	27.08.24	BRL	5 000 000	-	-5 000 000	-	-	0.00
Intl Fin 7% 17-20.07.27	7.000	20.07.27	MXN	99 000 000	-	-25 000 000	74 000 000	3 695 640.04	1.26
Iss Global 3.875% 24-05.06.29	3.875	05.06.29	EUR	-	2 000 000	-	2 000 000	2 151 532.77	0.73
Jsw Hy 4.125% 18.05.31 /Pool Regs	4.125	18.05.31	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Keppel Corp 2.459% 20-04.06.25	2.459	04.06.25	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 944 176.70	0.66
Lenovo Grp 5.875% 20-24.04.25	5.875	24.04.25	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Mdc 2.875% 19-07.11.29	2.875	07.11.29	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 802 330.00	0.61
Mdc 3% 17-19.04.24	3.000	19.04.24	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Mexico 7.5% 06-03.06.27 Bonos	7.500	03.06.27	MXN	420 000	-	-420 000	-	-	0.00
Mexico 7.75% 11-29.05.31 Bonos	7.750	29.05.31	MXN	490 000	-	-	490 000	2 390 705.06	0.81
Millicom Ic 5.125% 17-15.01.28	5.125	15.01.28	USD	1 200 000	-	-	1 200 000	1 019 834.28	0.35
Minejesa 4.625% 10.08.30 /Pool	4.625	10.08.30	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Nat Fin 2.374% 21-Perp	2.374	31.12.99	EUR	2 000 000	-	-	2 000 000	2 037 745.07	0.69
Nbm Us Hold 7% 19-14.05.26 Regs	7.000	14.05.26	USD	4 000 000	-	-1 000 000	3 000 000	3 003 153.00	1.02
Network I2I 5.65% 19-Perp	5.650	31.12.99	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 492 258.95	0.51
Nomura Hldg 2.172% 21-14.07.28	2.172	14.07.28	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 325 493.60	0.45
Norway 1.5% 16-19.02.26	1.500	19.02.26	NOK	20 000 000	-	-20 000 000	-	-	0.00
Norway 2% 18-26.04.28	2.000	26.04.28	NOK	-	25 000 000	-	25 000 000	2 214 154.51	0.75
Norwegian G 1.25% 21-17.09.31	1.250	17.09.31	NOK	95 000 000	-	-	95 000 000	7 599 698.20	2.58
Norwegian G 1.375% 20-19.08.30	1.375	19.08.30	NOK	82 000 000	-	-	82 000 000	6 758 365.22	2.30
Norwegian G 1.75% 19-06.09.29	1.750	06.09.29	NOK	20 000 000	-	-	20 000 000	1 714 442.92	0.58
Norwegian G 2.125% 22-18.05.32	2.125	18.05.32	NOK	-	40 000 000	-40 000 000	-	-	0.00
Oracle Corp	4.000	15.07.46	USD	2 500 000	-	-2 500 000	-	-	0.00
Poland 1.25% 19-25.10.30	1.250	25.10.30	PLN	31 000 000	5 000 000	-	36 000 000	6 960 879.33	2.36
Poland 1.75% 21-25.04.32	1.750	25.04.32	PLN	25 000 000	10 000 000	-	35 000 000	6 625 113.90	2.25
Qatar 3.40% 20-16.04.25 Regs	3.400	16.04.25	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Raizn Fuel 5.3% 17-20.01.27 Regs	5.300	20.01.27	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	983 168.20	0.33
San M / Ng 3.50% 21-02.08.28	3.500	02.08.28	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Sappi Papier H 3.625% 15.03.28	3.625	15.03.28	EUR	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Shriram Fin 6.625% 24-22.04.27	6.625	22.04.27	USD	-	600 000	-	600 000	601 063.20	0.20
Sig Combibl 2.125% 20-18.06.25	2.125	18.06.25	EUR	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Sigma	4.125	02.05.26	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Silgan Hldg 3.25% 17-15.03.25	3.250	15.03.25	EUR	2 000 000	-	-	2 000 000	2 124 656.23	0.72
Singapore 1.625% 21-01.07.31	1.625	01.07.31	SGD	35 000 000	-	-35 000 000	-	-	0.00
Softbank 2.875% 21-06.01.27	2.875	06.01.27	EUR	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Solvay 2.50% 20-Perp Regs	2.500	31.12.99	EUR	2 000 000	-	-	2 000 000	2 071 116.68	0.70
Swiss I 9.85% 16.07.32 /Pool Regs	9.850	16.07.32	BRL	12 000 000	-	-12 000 000	-	-	0.00
Targa Res 6.875% 19-15.01.29	6.875	15.01.29	USD	500 000	-	-	500 000	513 074.00	0.17
Telefonica	5.875	31.12.99	EUR	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Telefonica 2.88% 21-Perp	2.880	31.12.99	EUR	1 500 000	-	-	1 500 000	1 505 802.05	0.51
The Kraft 4.375% 16-01.06.46	4.375	01.06.46	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
T-Mobile Us 2.25% 21-15.02.26	2.250	15.02.26	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	950 458.00	0.32
T-Mobile Us 2.625% 21-15.02.29	2.625	15.02.29	USD	3 000 000	-	-1 500 000	1 500 000	1 344 763.35	0.46
Uk T Bill 0.25% 20-31.07.31	0.250	31.07.31	GBP	12 000 000	-	-2 000 000	10 000 000	9 726 933.48	3.30
Uk T Bill 0.625% 20-31.07.35	0.625	31.07.35	GBP	-	3 000 000	-1 000 000	2 000 000	1 726 760.60	0.59
Usa 0.50% 20-30.06.27 /Tbo	0.500	30.06.27	USD	15 000 000	-	-7 000 000	8 000 000	7 111 093.76	2.42
Usa 0.875% 20-15.11.30 /Tbo	0.875	15.11.30	USD	20 000 000	-	-3 000 000	17 000 000	13 770 000.00	4.68
Usa 1.125% 20-15.05.40 /Tbo	1.125	15.05.40	USD	20 000 000	-	-20 000 000	-	-	0.00
Usa 1.25% 21-30.06.28 /Tbo	1.250	30.06.28	USD	25 000 000	-	-	25 000 000	22 134 277.25	7.52
Usa 1.375% 21-15.11.31 /Tbo	1.375	15.11.31	USD	-	10 700 000	-	10 700 000	8 717 783.16	2.96
Usa 1.50% 23-15.02.53 /Infl	1.500	15.02.53	USD	-	5 000 000	-3 500 000	1 500 000	1 326 394.23	0.45
Usa 1.625% 19-30.11.26 /Tbo	1.625	30.11.26	USD	11 500 000	-	-11 500 000	-	-	0.00
Usa 1.75% 19-15.11.29 /Tbo	1.750	15.11.29	USD	17 500 000	5 000 000	-3 000 000	19 500 000	17 143 623.12	5.82
Usa 2.375% 22-15.02.42 /Tbo	2.375	15.02.42	USD	13 000 000	-	-13 000 000	-	-	0.00
Usa 3.125% 22-15.08.25 /Tbo	3.125	15.08.25	USD	5 000 000	-	-5 000 000	-	-	0.00
Usa 3.875% 23-15.08.33 Tbo	3.875	15.08.33	USD	-	21 000 000	-4 000 000	17 000 000	16 392 714.78	5.57

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Total Return Global (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Vmware Inc 3.9% 17-21.08.27	3.900	21.08.27	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	959 886.98	0.33
Vmware Inc 4.70% 20-15.05.30	4.700	15.05.30	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	968 477.78	0.33
Western Dig 4.75% 18-15.02.26	4.750	15.02.26	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
								265 518 233.74	90.20

Indexoptionen

Usd/Mxn Spot Cross		02.11.23	USD	-	5 555 555	-5 555 555	-	-	0.00
Usd/Mxn Spot Cross		11.07.24	USD	-	8 571 429	-8 571 429	-	-	0.00
Usd/Mxn Spot Cross		11.07.24	USD	-	9 259 259	-9 259 259	-	-	0.00
Usd/Mxn Spot Cross		11.07.24	USD	-	8 287 293	-8 287 293	-	-	0.00
								-	0.00

Schatzwechsel

Usa 0% 22-02.11.23 Tb		02.11.23	USD	-	2 000 000	-2 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 22-30.11.23 Tb		30.11.23	USD	-	5 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-02.04.24 Tb		02.04.24	USD	-	5 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-04.01.24 Tb		04.01.24	USD	-	7 000 000	-7 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-05.12.23 Tb		05.12.23	USD	-	5 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-06.02.24 Tb		06.02.24	USD	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-08.08.23 Tb		08.08.23	USD	-	6 000 000	-6 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-09.04.24 Tb		09.04.24	USD	-	4 500 000	-4 500 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-12.09.23 Tb		12.09.23	USD	-	6 000 000	-6 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-12.10.23 Tb		12.10.23	USD	-	8 000 000	-8 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-12.12.23 Tb		12.12.23	USD	-	6 000 000	-6 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-13.02.24 Tb		13.02.24	USD	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-14.11.23 Tb		14.11.23	USD	-	5 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-16.04.24 Tb		16.04.24	USD	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-17.08.23 Tb		17.08.23	USD	-	6 000 000	-6 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-18.01.24 Tb		18.01.24	USD	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-19.03.24 Tb		19.03.24	USD	-	5 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-20.02.24 Tb		20.02.24	USD	-	5 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-21.12.23 Tb		21.12.23	USD	-	5 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-23.04.24 Tb		23.04.24	USD	-	5 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-24.11.23 Tb		24.11.23	USD	-	10 000 000	-10 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-25.01.24 Tb		25.01.24	USD	-	3 000 000	-3 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-26.03.24 Tb		26.03.24	USD	-	5 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-26.09.23 Tb		26.09.23	USD	-	8 000 000	-8 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-26.10.23 Tb		26.10.23	USD	-	6 000 000	-6 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-27.02.24 Tb		27.02.24	USD	-	5 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-27.07.23 Tb		27.07.23	USD	10 000 000	-	-10 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-28.11.23 Tb		28.11.23	USD	-	5 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-29.02.24 Tb		29.02.24	USD	-	10 000 000	-10 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-29.08.23 Tb		29.08.23	USD	-	6 000 000	-6 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 24-04.06.24 Tb		04.06.24	USD	-	4 000 000	-4 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 24-05.07.24 Tb		05.07.24	USD	-	3 000 000	-	3 000 000	2 998 254.99	1.02
Usa 0% 24-18.06.24 Tb		18.06.24	USD	-	5 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
Usa 0% 24-25.06.24 Tb		25.06.24	USD	-	5 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
								2 998 254.99	1.02

Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

268 516 488.73 **91.22**

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Anleihen

Allstate	8.520	15.08.53	USD	3 000 000	-	-	3 000 000	3 001 539.00	1.02
Bpcm 4.375% 20-Perp	4.375	31.12.99	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	982 834.80	0.33
Chen Eng 4.50% 20-01.10.29	4.500	01.10.29	USD	3 500 000	-	-1 500 000	2 000 000	1 906 593.80	0.65

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Total Return Global (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Clearway 4.75% 19-15.03.28 144A	4.750	15.03.28	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	956 118.30	0.33
Cosan Lux 7% 16-20.01.27	7.000	20.01.27	USD	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Count Gard 3.125% 20-22.10.25	3.125	22.10.25	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
Dcp Mid Op 5.125% 19-15.05.29	5.125	15.05.29	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 990 491.60	0.68
Enlink Midstr 6.50% 01.09.30 Regs	6.500	01.09.30	USD	500 000	-	-	500 000	511 915.50	0.17
Entel 3.05% 21-14.09.32 /Pool	3.050	14.09.32	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 616 447.40	0.55
Eqd Mdstm 4.50% 21-15.01.29	4.500	15.01.29	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Flex Ltd 3.75% 20-01.02.26	3.750	01.02.26	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	970 884.51	0.33
Hess Midstr 5.125% 19-15.06.28	5.125	15.06.28	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	968 998.60	0.33
Mexico Cete 7.50% 22-26.05.33	7.500	26.05.33	MXN	580 000	50 000	-	630 000	2 967 578.15	1.01
Rural Elec 2.75% 21-13.01.27	2.750	13.01.27	USD	2 000 000	-	-	2 000 000	1 866 579.28	0.63
Sd Hi-Sp Gr 2.437% 20-19.11.23	2.437	19.11.23	USD	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Seagate Hdd 9.625% 22-01.12.32	9.625	01.12.32	USD	3 120 000	-	-3 120 000	-	-	0.00
Shriram 4.15% 22-18.07.25 Regs	4.150	18.07.25	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	975 670.00	0.33
Targa Res Par 4% 22-15.01.32	4.000	15.01.32	USD	1 500 000	-	-1 500 000	-	-	0.00
Targa Res Par 6.5% 19-15.07.27	6.500	15.07.27	USD	1 500 000	-	-	1 500 000	1 510 810.50	0.51
Transm 5.20% 11.04.38 /Pool	5.200	11.04.38	USD	1 300 000	-	-1 300 000	-	-	0.00
Western Gas 3.10% 20-01.02.25	3.100	01.02.25	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	983 475.90	0.33
Western Gas 4.05% 20-01.02.30	4.050	01.02.30	USD	1 000 000	-	-	1 000 000	930 785.20	0.32
Xiaomi Best 3.375% 20-29.04.30	3.375	29.04.30	USD	1 000 000	-	-1 000 000	-	-	0.00
								22 140 722.54	7.52
Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere								22 140 722.54	7.52
				01.07.2023			Schlussbestand 30.06.2024	USD	
Sonstige übertragbare Wertpapiere									
Anleihen									
Ebrd 5.0% 19-05.11.24	5.000	05.11.24	RUB	100 000 000	-	-100 000 000	-	-	0.00
								-	0.00
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere								-	0.00
SUMME WERTPAPIERBESTAND								290 657 211.27	98.74
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								3 985 453.49	1.35
Sonstige Passiven								-284 867.30	-0.09
GESAMTNETTOVERMÖGEN								294 357 797.46	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Aktien									
Activision Blizzard Inc			USD	19 727	3 012	-22 739	-	-	0.00
Adidas Ag			EUR	-	2 400	-	2 400	573 600.60	1.03
Adobe Systems			USD	-	3 520	-3 520	-	-	0.00
Alphabet Inc -A-			USD	12 487	3 272	-5 502	10 257	1 868 312.55	3.34
Amazon Com Inc			USD	21 992	18 715	-11 915	28 792	5 564 054.00	9.95
Apple Inc			USD	-	6 259	-266	5 993	1 262 245.66	2.26
Basic-Fit N.V.			EUR	16 615	3 281	-19 896	-	-	0.00
Booking Holdings Inc			USD	462	116	-220	358	1 418 217.00	2.54
Brunello Cucinelli Spa			EUR	-	13 719	-1 672	12 047	1 207 213.31	2.16
Chipotle Mexican Grill Inc			USD	1 058	53 215	-8 505	45 768	2 867 365.20	5.13
Cie Financiere Richemont Nam-Ak			CHF	15 286	8 445	-14 337	9 394	1 466 178.79	2.62
Cts Eventim Akt.			EUR	18 737	5 124	-8 220	15 641	1 305 856.53	2.34
Dav Cam Mil Rg			EUR	25 065	138 991	-68 982	95 074	899 126.42	1.61
Deckers Outdoor Corp.			USD	1 479	1 686	-2 124	1 041	1 007 635.95	1.80
Dsm-Firmenich Ltd			EUR	9 292	4 809	-14 101	-	-	0.00
Electronic Arts			USD	13 991	13 695	-19 915	7 771	1 082 733.43	1.94
Essilor International			EUR	6 793	1 608	-5 355	3 046	656 827.56	1.17
Facebook Inc -A-			USD	-	3 757	-210	3 547	1 788 468.34	3.20
Ferrari N.V.			EUR	4 370	2 182	-1 777	4 775	1 948 272.70	3.48
Haleon Rg			GBP	224 031	159 309	-59 984	323 356	1 318 641.44	2.36
Hermes International			EUR	751	334	-164	921	2 112 354.95	3.78
Infineon Technologies /Nam.			EUR	33 098	21 325	-26 513	27 910	1 026 149.77	1.84
Intercontinental Hotels Group Plc			GBP	20 251	5 479	-15 174	10 556	1 111 008.09	1.99
Intercos Spa			EUR	-	33 284	-	33 284	540 076.00	0.97
L Occitane International Sa			HKD	326 080	41 002	-367 082	-	-	0.00
L Oreal			EUR	3 405	1 777	-578	4 604	2 023 324.89	3.62
Lilly (Eli) & Co			USD	2 578	570	-2 225	923	835 665.74	1.49
Lululemon Athletica Inc			USD	-	1 404	-1 404	-	-	0.00
Lvmh Act.			EUR	3 649	1 175	-2 958	1 866	1 427 118.29	2.55
Mastercard Inc. Shs-A-			USD	4 884	2 048	-2 614	4 318	1 904 928.88	3.41
Mercadolibre Inc			USD	809	1 047	-704	1 152	1 893 196.80	3.39
Microsoft Corp			USD	6 034	2 002	-1 102	6 934	3 099 151.30	5.54
Mips Ab			SEK	5 479	8 947	-2 458	11 968	468 992.47	0.84
Moncler S.P.A.			EUR	-	25 930	-5 183	20 747	1 268 763.18	2.27
Nestle / Act Nom			CHF	12 317	6 634	-7 780	11 171	1 140 222.50	2.04
Nike Inc B			USD	10 984	7 478	-18 462	-	-	0.00
Novo Nordisk As -B-			DKK	-	6 652	-1 170	5 482	792 257.57	1.42
Novonesis A/S -B-			DKK	-	22 076	-	22 076	1 351 867.16	2.42
Nvidia Corp.			USD	3 048	19 610	-4 208	18 450	2 279 313.00	4.08
On Semiconductor Corp			USD	7 577	1 496	-9 073	-	-	0.00
Pernod-Ricard			EUR	5 474	531	-6 005	-	-	0.00
Planet Fitness Inc			USD	21 918	4 106	-26 024	-	-	0.00
Prada – Registered Shs			HKD	166 288	8 800	-175 088	-	-	0.00
Puma Se			EUR	13 986	2 220	-16 206	-	-	0.00
Rightmove Plc			GBP	-	130 754	-11 755	118 999	807 791.03	1.44
Shimano Inc.			JPY	4 324	1 462	-2 227	3 559	549 691.74	0.98
Tencent Holdings Ltd			HKD	22 800	8 746	-31 546	-	-	0.00
The Trade Desk Inc			USD	13 401	9 449	-17 785	5 065	494 698.55	0.88
Trainline Plc			GBP	-	122 153	-122 153	-	-	0.00
Unilever Plc			EUR	-	16 551	-23	16 528	908 367.97	1.62

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Univ Mu Gr Br Rg			EUR	41 853	10 278	-18 412	33 719	1 003 923.04	1.80
Walt Disney Company			USD	-	4 775	-	4 775	474 109.75	0.85
								53 747 722.15	96.15
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind								53 747 722.15	96.15
SUMME WERTPAPIERBESTAND								53 747 722.15	96.15
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen								3 126 674.52	5.59
Sonstige Passiven								-976 254.37	-1.74
GESAMTNETTOVERMÖGEN								55 898 142.30	100.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Aktien									
Adobe Systems			USD	8 484	11 074	-4 328	15 230	8 460 874.20	2.06
Advanced Micro Devices Inc			USD	33 917	34 317	-15 031	53 203	8 630 058.63	2.10
Alphabet Inc -A-			USD	90 386	88 415	-33 771	145 030	26 417 214.50	6.43
Altium			AUD	139 560	-	-139 560	-	-	0.00
Amazon Com Inc			USD	75 303	97 568	-72 769	100 102	19 344 711.50	4.71
American Tower Corp			USD	13 894	9 777	-23 671	-	-	0.00
Analog Devices Inc			USD	52 008	27 271	-24 324	54 955	12 544 028.30	3.05
Apple Inc			USD	29 037	62 983	-	92 020	19 381 252.40	4.71
Applied Materials Inc			USD	76 462	33 479	-34 061	75 880	17 906 921.20	4.36
Coherent Rg			USD	69 429	123 110	-14 619	177 920	12 892 083.20	3.14
Cohu Inc			USD	-	255 765	-54 181	201 584	6 672 430.40	1.62
Elastic B.V.			USD	35 693	26 549	-11 722	50 520	5 754 733.20	1.40
Emerson Electric Co.			USD	-	38 641	-	38 641	4 256 692.56	1.04
Facebook Inc -A-			USD	18 597	9 538	-7 403	20 732	10 453 489.04	2.54
Flsmidth & Co. A/S B			DKK	161 238	18 672	-67 414	112 496	5 597 140.95	1.36
Intel Corp.			USD	281 672	146 553	-115 708	312 517	9 678 651.49	2.35
Keysight Technologies Inc			USD	38 114	26 924	-21 915	43 123	5 897 070.25	1.43
Kion Group / Eq Usd			EUR	59 403	-	-29 450	29 953	1 254 872.17	0.31
Lundin Mining Corp			CAD	246 162	-	-246 162	-	-	0.00
Micron Technology Inc			USD	78 993	51 937	-44 326	86 604	11 391 024.12	2.77
Microsoft Corp			USD	56 141	35 060	-3 743	87 458	39 089 353.10	9.51
Monday.Com Rg			USD	-	33 914	-8 370	25 544	6 149 973.44	1.50
Nokia Oy			EUR	773 631	1 788 565	-	2 562 196	9 771 760.44	2.38
Nvidia Corp.			USD	31 484	294 328	-35 304	290 508	35 889 358.32	8.73
Onto Innovation			USD	108 807	-	-48 461	60 346	13 249 567.76	3.22
Outotec Oyj			EUR	622 659	157 309	-196 837	583 131	6 177 209.89	1.50
Palo Alto Networks Inc			USD	44 181	30 539	-42 555	32 165	10 904 256.65	2.65
Rohm Co.Ltd			JPY	76 495	229 485	-	305 980	4 089 627.25	0.99
Salesforce Com Inc			USD	39 055	-	-22 370	16 685	4 289 713.50	1.04
Samsung El./Sp.Gdr (1/2Vot144a)			USD	2 229	7 446	-	9 675	14 319 000.00	3.48
Servicenow Inc			USD	23 193	6 314	-6 369	23 138	18 201 970.46	4.43
Stmicroelectronics Nv			EUR	118 405	89 180	-86 837	120 748	4 770 761.18	1.16
Synopsys Inc.			USD	39 714	5 721	-23 220	22 215	13 219 257.90	3.22
Tencent Holdings Ltd			HKD	154 896	-	-	154 896	7 388 304.01	1.80
The Trade Desk Inc			USD	77 392	62 493	-62 952	76 933	7 514 046.11	1.83
Tokyo Electron Co Ltd			JPY	46 285	3 900	-	50 185	10 888 086.96	2.65
Twilio Inc -A-			USD	-	37 014	-37 014	-	-	0.00
Ubisoft Entertainment			EUR	34 544	-	-34 544	-	-	0.00
Walt Disney Company			USD	51 952	38 064	-18 693	71 323	7 081 660.67	1.72
Zscaler Inc			USD	22 605	30 687	-20 428	32 864	6 316 132.16	1.54
							405 843 287.91	98.73	
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind							405 843 287.91	98.73	
SUMME WERTPAPIERBESTAND							405 843 287.91	98.73	
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen							5 383 542.68	1.31	
Sonstige Passiven							-142 682.82	-0.04	
GESAMTNETTOVERMÖGEN							411 084 147.77	100.00	

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
-------------	---	------------------------	---------	------------------------------	--------	-----------	------------------------------	---------------------	------------------------------

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind

Aktien

Romania 3.875% 15-29.10.35			EUR	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
								-	0.00

Anleihen

Adb 0% 16-05.04.46	0.000	05.04.46	ZAR	-	150 000 000	-150 000 000	-	-	0.00
Argentina 15.5% 16-17.10.26	15.500	17.10.26	ARS	241 500 000	395 546 160	-	637 046 160	425 505.99	3.31
Argentina 16% 16-17.10.23	16.000	17.10.23	ARS	35 100 000	-	-35 100 000	-	-	0.00
Brazil 10.0% 22-01.01.33	10.000	01.01.33	BRL	-	7 000	-7 000	-	-	0.00
Brazil 6% 10-15.08.50 /Infl	6.000	15.08.50	BRL	-	2 000	-2 000	-	-	0.00
Brazil 6.0% 23-20.10.33	6.000	20.10.33	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Chile 4.7% 18-01.09.30	4.700	01.09.30	CLP	900 000 000	-	-900 000 000	-	-	0.00
Colombia 7.50% 23-02.02.34	7.500	02.02.34	USD	-	500 000	-500 000	-	-	0.00
Colombia 8.125% 04-21.05.24	8.125	21.05.24	USD	400 000	-	-400 000	-	-	0.00
Colombia 9.85% 07-27 /Int.Usd	9.850	28.06.27	COP	4 600 000 000	-	-	4 600 000 000	1 068 599.20	8.31
Croatia 6% 13-26.01.24	6.000	26.01.24	USD	-	1 600 000	-1 600 000	-	-	0.00
Czech Rep 1.25% 20-14.02.25	1.250	14.02.25	CZK	-	30 000 000	-	30 000 000	1 260 520.09	9.81
Czech Rep 2% 17-13.10.33	2.000	13.10.33	CZK	26 000 000	-	-	26 000 000	933 631.58	7.26
Ebrd 4.95% 21-22.01.26	4.950	22.01.26	INR	50 000 000	-	-50 000 000	-	-	0.00
Egypt 8.875% 20-29.05.50 Regs	8.875	29.05.50	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Eib 2.60% 22-29.09.26	2.600	29.09.26	CNH	7 000 000	-	-7 000 000	-	-	0.00
Emp 8.375% 17-08.11.27 Regs	8.375	08.11.27	COP	3 000 000 000	-	-3 000 000 000	-	-	0.00
Far East Ho 4.70% 21-09.02.24	4.700	09.02.24	CNH	9 000 000	-	-9 000 000	-	-	0.00
Hungary 4.0% 21-28.04.51	4.000	28.04.51	HUF	200 000 000	150 000 000	-	350 000 000	623 299.98	4.85
Hungary 5.75% 13-22.11.23	5.750	22.11.23	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
Hungary 9.5% 23-21.10.26	9.500	21.10.26	HUF	-	280 000 000	-	280 000 000	804 875.76	6.26
Ibrd 0% 15-29.05.35	0.000	29.05.35	ZAR	30 000 000	70 000 000	-100 000 000	-	-	0.00
Indonesia 6.375% 21-15.04.32	6.375	15.04.32	IDR	-	7 500 000 000	-7 500 000 000	-	-	0.00
Indonesia 8.375% 18-15.04.39	8.375	15.04.39	IDR	15 000 000 000	-	-15 000 000 000	-	-	0.00
Intl Bk Rec 2.25% 22-19.01.29	2.250	19.01.29	CNH	5 000 000	-	-5 000 000	-	-	0.00
Intl Bk Rec 6.25% 23-19.01.29	6.250	19.01.29	IDR	15 000 000 000	-	-15 000 000 000	-	-	0.00
Intl Fin 0% 18-22.02.38	0.000	22.02.38	MXN	40 000 000	50 000 000	-90 000 000	-	-	0.00
Mexico	5.750	05.03.26	MXN	-	50 000	-	50 000	252 904.55	1.97
Mexico 10% 05-5.12.24 -M-	10.000	05.12.24	MXN	-	150 000	-100 000	50 000	271 754.24	2.11
Mexico 8% 17-07.11.47	8.000	07.11.47	MXN	60 000	90 000	-	150 000	670 422.93	5.22
Mexico Cete 5% 21-06.03.25	5.000	06.03.25	MXN	-	50 000	-	50 000	263 514.13	2.05
Peru 5.35% 19-12.08.40	5.350	12.08.40	PEN	2 500 000	2 500 000	-5 000 000	-	-	0.00
Poland 1.75% 21-25.04.32	1.750	25.04.32	PLN	3 500 000	-	-	3 500 000	662 511.39	5.16
Poland 2.5% 18-25.04.24	2.500	25.04.24	PLN	-	3 500 000	-3 500 000	-	-	0.00
Poland 3.25% 13-25.07.25	3.250	25.07.25	PLN	-	5 000 000	-	5 000 000	1 222 406.45	9.51
Poland 6.0% 22-25.10.33	6.000	25.10.33	PLN	-	1 500 000	-	1 500 000	382 366.32	2.98
Qnb Fin 6.90% 20-23.01.25	6.900	23.01.25	IDR	4 000 000 000	-	-4 000 000 000	-	-	0.00
Romania 2.75% 21-14.04.41	2.750	14.04.41	EUR	900 000	-	-900 000	-	-	0.00
Simpar Fin 10.75% 12.02.28 Regs	10.750	12.02.28	BRL	6 000 000	-	-6 000 000	-	-	0.00
South Afr 8.5% 13-31.01.37	8.500	31.01.37	ZAR	27 000 000	-	-27 000 000	-	-	0.00
South Afr 8.75% 14-31.01.44	8.750	31.01.44	ZAR	37 000 000	-	-37 000 000	-	-	0.00
South Africa 4.665% 12-17.01.24	4.665	17.01.24	USD	500 000	-	-500 000	-	-	0.00
South Africa 6.5% 10-28.02.41	6.500	28.02.41	ZAR	30 000 000	-	-30 000 000	-	-	0.00
Swiss I 9.85% 16.07.32 /Pool Regs	9.850	16.07.32	BRL	3 000 000	-	-3 000 000	-	-	0.00
Usa 4.875% 23-30.11.25 /Tbo	4.875	30.11.25	USD	-	600 000	-600 000	-	-	0.00
								8 842 312.61	68.80

Schatzwechsel

Usa 0% 23-05.09.24 Tb		05.09.24	USD	-	1 000 000	-	1 000 000	990 452.92	7.70
-----------------------	--	----------	-----	---	-----------	---	-----------	------------	------

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Usa 0% 23-13.06.24 Tb		13.06.24	USD	-	1 700 000	-1 700 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-14.03.24 Tb		14.03.24	USD	-	3 200 000	-3 200 000	-	-	0.00
Usa 0% 23-21.03.24 Tb		21.03.24	USD	-	1 200 000	-1 200 000	-	-	0.00
								990 452.92	7.70

Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind **9 832 765.53** **76.50**

Übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden

Anleihen

Brazil 10% 20-01.01.31	10.000	01.01.31	BRL	6 000	-	-6 000	-	-	0.00
Dominican R 9.75% 19-05.06.26 Regs	9.750	05.06.26	DOP	20 000 000	-	-20 000 000	-	-	0.00
Ebrd 4.60% 20-09.12.25	4.600	09.12.25	IDR	17 500 000 000	-	-17 500 000 000	-	-	0.00
Malaysia 2.632% 20-15.04.31	2.632	15.04.31	MYR	6 000 000	-	-6 000 000	-	-	0.00
Malaysia 4.065% 20-15.06.50	4.065	15.06.50	MYR	3 000 000	2 000 000	-5 000 000	-	-	0.00
Mexico 8% 19-05.09.24	8.000	05.09.24	MXN	-	150 000	-150 000	-	-	0.00
Mexico Cete 7% 23-03.09.26	7.000	03.09.26	MXN	-	50 000	-	50 000	254 356.62	1.98
Mexico Cete 7.50% 22-26.05.33	7.500	26.05.33	MXN	-	50 000	-	50 000	235 522.08	1.83
Mexico Cete 8% 22-31.07.53	8.000	31.07.53	MXN	140 000	60 000	-	200 000	883 736.20	6.88
Min Of Fin 2.875% 16-17.06.46	2.875	17.06.46	THB	20 000 000	-	-20 000 000	-	-	0.00
								1 373 614.90	10.69

Summe der an einem anderen geregelten Markt gehandelten übertragbaren Wertpapiere **1 373 614.90** **10.69**

01.07.2023

Schlussbestand
30.06.2024

USD

Sonstige übertragbare Wertpapiere

Anleihen

Malaysia 4.369% 18-31.10.28	4.369	31.10.28	MYR	2 000 000	-	-2 000 000	-	-	0.00
Min Fin Ruf 6.9% 18-23.05.29**	0.000	23.05.29	RUB	70 000 000	-	-	70 000 000	-	0.00
Min Fin Ruf 7.70% 19-16.03.39**	0.000	16.03.39	RUB	75 000 000	-	-	75 000 000	-	0.00
Min Fin Th 4% 22-17.06.72	4.000	17.06.72	THB	-	10 000 000	-	10 000 000	281 393.23	2.19
Rabobk Ny 0.50% 14-26.02.29	0.500	26.02.29	HUF	200 000 000	-	-200 000 000	-	-	0.00
Russia 7.05% 13-19.01.28**	0.000	19.01.28	RUB	70 000 000	-	-	70 000 000	-	0.00
Russia 7.1% 17-16.10.24**	0.000	16.10.24	RUB	-	-	50 000 000	50 000 000	-	0.00
Russia 8.15% 12-03.02.27 S 26207**	0.000	03.02.27	RUB	115 000 000	-	-	115 000 000	-	0.00
								281 393.23	2.19

Summe sonstige übertragbare Wertpapiere **281 393.23** **2.19**

SUMME WERTPAPIERBESTAND **11 487 773.66** **89.38**

Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen **1 195 028.78** **9.30**

Sonstige Aktiven **169 931.02** **1.32**

GESAMTNETTOVERMÖGEN **12 852 733.46** **100.00**

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:

Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

** Siehe Erläuterung 17

JSS Equity - All China

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Aktien									
Accelink Technologies Co -A-			CNH	510 369	-	-510 369	-	-	0.00
Adv Micro-A Rg			CNH	-	95 686	-95 686	-	-	0.00
Agricult Bk China /H-Shares			HKD	-	19 094 000	-7 296 000	11 798 000	5 047 191.01	2.40
Ah Yingjia Dist -A-			CNH	-	230 500	-230 500	-	-	0.00
Alibaba Group Holding Ltd			HKD	708 500	331 500	-511 100	528 900	4 775 925.75	2.27
Anhui			CNH	-	272 800	-272 800	-	-	0.00
Anhui Gujing Distillery Co Ltd			CNH	24 190	156 845	-142 700	38 335	1 113 582.26	0.53
Anhui Kouzi Distillery Co Ltd			CNH	451 786	187 800	-639 586	-	-	0.00
Asia-Potash In Rg-A			CNH	-	518 300	-518 300	-	-	0.00
Baidu Inc -A-/Adr			USD	8 596	-	-8 596	-	-	0.00
Baidu Rg-A			HKD	156 950	-	-156 950	-	-	0.00
Bank Of Ningbo Co Ltd			CNH	687 927	1 874 860	-2 562 787	-	-	0.00
Beij Or Ywt			CNH	395 900	-	-395 900	-	-	0.00
Beijing Tongrentang Co Ltd -A-			CNH	-	213 500	-213 500	-	-	0.00
Bilibili-Z Rg			HKD	-	136 940	-98 900	38 040	618 296.82	0.29
Bj Chunliz /H			HKD	1 193 000	-	-1 193 000	-	-	0.00
Bj Kingsoft Rg-A			CNH	21 850	-	-21 850	-	-	0.00
Bj Robo Rg-A			CNH	-	18 796	-	18 796	1 015 584.49	0.48
Brilliance China Automotive			HKD	-	4 730 000	-	4 730 000	4 973 924.40	2.36
Byd Company Limited -H-			HKD	-	52 500	-18 500	34 000	1 010 326.59	0.48
Byd Company Ltd -A-			CNH	-	161 250	-109 650	51 600	1 777 150.12	0.84
Cgn Power Co Ltd			HKD	-	7 532 000	-	7 532 000	3 318 666.69	1.58
China Construction Bank Co -H-			HKD	-	16 542 000	-7 019 000	9 523 000	7 037 922.49	3.35
China Cosco Holdings -H-			HKD	2 888 000	5 479 500	-6 233 500	2 134 000	3 733 704.96	1.78
China Cssc Holdings Ltd			CNH	1 644 730	630 600	-1 328 500	946 830	5 304 854.03	2.52
China Int Travel Serv Corp			CNH	-	49 700	-49 700	-	-	0.00
China Life Insurance Co Ltd-H-			HKD	-	2 842 000	-	2 842 000	4 018 722.60	1.91
China Merchants Bank Co -A-			CNH	2 182 147	-	-773 000	1 409 147	6 630 644.29	3.15
China Overseas Land+Investment			HKD	-	894 500	-	894 500	1 551 293.21	0.74
China Paci Insu (Group) Ltd -H-			HKD	-	544 400	-544 400	-	-	0.00
China Pacific Insur -A-			CNH	498 500	685 600	-1 184 100	-	-	0.00
China Resources Land			HKD	-	445 000	-	445 000	1 513 280.44	0.72
China Shenhua Energy Co -H-			HKD	-	1 641 000	-1 641 000	-	-	0.00
China State Constr Engineer-A-			CNH	6 830 371	-	-6 830 371	-	-	0.00
China Yangtze Power Co Ltd -A-			CNH	-	5 157 400	-3 719 000	1 438 400	5 725 036.93	2.72
China Yuhua Education Corp Ltd			HKD	-	14 000 000	-14 000 000	-	-	0.00
Chinasoft International			HKD	-	1 180 000	-1 180 000	-	-	0.00
Chong Qing Changan Auto -A-			CNH	-	476 800	-476 800	-	-	0.00
Cloud Village Rg			HKD	-	92 600	-41 550	51 050	657 138.16	0.31
Cn Nat Nuclear – Shs -A-			CNH	-	712 800	-	712 800	1 045 743.64	0.50
Cn Universe			CNH	-	757 026	-757 026	-	-	0.00
Contemp			CNH	437 005	155 300	-341 300	251 005	6 219 100.61	2.96
Cosco Shipping Engy Tpy -H-			HKD	-	1 712 000	-606 000	1 106 000	1 436 441.57	0.68
Dada Nexus/ Sadr			USD	330 399	-	-330 399	-	-	0.00
Datong Coal Industry Co..Ltd			CNH	-	2 544 400	-2 544 400	-	-	0.00
Dian Diagnos-A Rg			CNH	-	220 600	-220 600	-	-	0.00
East Money Information Co -A-			CNH	1 808 760	-	-1 808 760	-	-	0.00
Foxconn Ind Int-Registered-A-			CNH	-	819 400	-819 400	-	-	0.00
G-Bits Network-A Rg			CNH	-	38 200	-38 200	-	-	0.00
Geely Automobile Hld Ltd			HKD	-	2 173 000	-2 173 000	-	-	0.00
Great Wall Motor Co Ltd -H-			HKD	-	296 500	-296 500	-	-	0.00
Gree Elec Appl Inc Of Zhuhai-A			CNH	-	697 800	-697 800	-	-	0.00
Greentown Mgmt Rg			HKD	2 735 000	995 000	-3 730 000	-	-	0.00

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Equity - All China (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
H.K.Exchanges And Clearing Ltd			HKD	125 000	-	-125 000	-	-	0.00
Haier Smart			CNH	-	845 544	-	845 544	3 302 546.44	1.57
Henan Shenhua Coal Ind.-A-			CNH	-	2 523 244	-1 798 200	725 044	2 018 647.85	0.96
Hisense Hm			CNH	-	872 237	-628 100	244 137	1 083 250.65	0.52
Hsbc Holdings Plc			HKD	-	244 400	-	244 400	2 138 044.73	1.02
Hygon Inform Rg-A			CNH	-	158 187	-	158 187	1 530 911.12	0.73
Hz Hh Digi Rg-A			CNH	-	62 171	-62 171	-	-	0.00
Hz Youngsun -A-			CNH	-	422 600	-422 600	-	-	0.00
Icbc -A-			CNH	7 325 193	-	-7 325 193	-	-	0.00
Innovent Biologics. Inc.			HKD	-	684 500	-684 500	-	-	0.00
Jd.Com Rg-A			HKD	-	98 400	-98 400	-	-	0.00
Jiangsu Hendrui Medicine Co-A-			CNH	774 380	907 030	-774 380	907 030	4 800 995.07	2.28
Jiangsu Yoke-A-			CNH	-	229 400	-229 400	-	-	0.00
Jsu Yanghe			CNH	151 319	-	-151 319	-	-	0.00
Jushri Techno-A Rg			CNH	-	461 134	-461 134	-	-	0.00
Kingsemi Rg-A			CNH	74 217	-	-74 217	-	-	0.00
Kuaishou Tech Rg-B			HKD	-	75 100	-75 100	-	-	0.00
Kweichow Moutai Co Ltd -A-			CNH	97 656	10 700	-44 400	63 956	12 915 974.44	6.14
Laopu Gold Co. Ltd. /H			HKD	-	30 000	-30 000	-	-	0.00
Lenovo Group Ltd			HKD	-	3 076 000	-1 400 000	1 676 000	2 365 650.00	1.12
Lepu Biopharma Co. Ltd. /H			HKD	-	2 045 000	-2 045 000	-	-	0.00
Lepu Medical Tech -A-			CNH	2 515 236	2 644 600	-5 159 836	-	-	0.00
Li Auto Inc - A - Shs			HKD	-	208 900	-208 900	-	-	0.00
Luxshare Precis			CNH	-	448 400	-254 000	194 400	1 051 718.80	0.50
Luzhou Old Cellar Co Ltd-A-			CNH	152 400	128 700	-281 100	-	-	0.00
Meituan Dianping			HKD	330 200	948 000	-890 800	387 400	5 512 753.29	2.62
Midea Group Co Ltd -A-			CNH	606 300	104 000	-173 800	536 500	4 762 442.79	2.26
Muyuan Foodstuff Co Ltd			CNH	-	175 339	-	175 339	1 052 120.15	0.50
Naura Technology Group Co Ltd			CNH	166 700	69 900	-43 100	193 500	8 518 869.41	4.05
Netease Rg			HKD	344 500	538 600	-424 300	458 800	8 761 852.43	4.17
New Orient Edu Rg			HKD	-	43 300	-43 300	-	-	0.00
Nx Baofeng Ene-A Rg			CNH	-	1 753 000	-1 753 000	-	-	0.00
Petrochina Co Ltd /-H-			HKD	-	17 822 000	-9 232 000	8 590 000	8 691 908.32	4.13
Pinduoduo Inc /Adr			USD	288 841	9 238	-220 288	77 791	10 342 313.45	4.92
Ping An Bank Co -A- Shs -A-			CNH	625 800	-	-625 800	-	-	0.00
Pony Testing Rg-A			CNH	472 702	425 431	-898 133	-	-	0.00
Rigol Techno Rg-A			CNH	312 819	-	-312 819	-	-	0.00
Shaanxi Ci			CNH	-	1 435 700	-652 400	783 300	2 778 068.06	1.32
Shanghai Aiko Rg-A			CNH	6 040 090	1 593 000	-7 633 090	-	-	0.00
Shanxi Xing Hua Cun Wine -A-			CNH	-	235 900	-200 400	35 500	1 030 300.89	0.49
Shenzhen Dynan-A Rg			CNH	-	18 440	-18 440	-	-	0.00
Sieyuan Electric Co Ltd			CNH	-	269 800	-269 800	-	-	0.00
Sinopec Engineering Grp Co Ltd			HKD	-	2 662 500	-	2 662 500	1 841 527.71	0.88
South West Eco Development Ltd			HKD	1 630 000	377 000	-2 007 000	-	-	0.00
Sungrow Power Supply Co Ltd			CNH	218 000	534 406	-595 800	156 606	1 336 935.66	0.64
Sx Coal & Elec -A-			CNH	-	1 429 532	-1 429 532	-	-	0.00
Sz Mindray			CNH	136 754	211 000	-237 454	110 300	4 416 055.17	2.10
Sz Transsion-A Rg			CNH	-	79 720	-	79 720	839 761.72	0.40
Tangshan Port Group Co Ltd			CNH	457 300	-	-457 300	-	-	0.00
Tencent Holdings Ltd			HKD	639 000	40 500	-265 600	413 900	19 742 401.53	9.39
Tjin Zh			CNH	5 643 081	-	-5 643 081	-	-	0.00
Tongkun Group Co Ltd			CNH	-	489 800	-	489 800	1 075 850.64	0.51
Trip Com Rg-S			HKD	-	68 350	-37 250	31 100	1 492 186.29	0.71
Tsingtao Brewery Co Ltd -H-			HKD	562 000	706 000	-912 000	356 000	2 375 650.80	1.13
Tuhu Car Rg-A Unty			HKD	-	643 500	-643 500	-	-	0.00
Wanhua Chemical Group Co -A-			CNH	173 400	537 920	-562 920	148 400	1 651 459.65	0.79
Wasion Holdings Limited			HKD	-	1 300 000	-1 300 000	-	-	0.00
Western Mining Co Ltd			CNH	-	1 113 400	-492 100	621 300	1 534 850.73	0.73

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Equity - All China (Fortsetzung)

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in USD	% des Netto- vermögens
Wh Huazhong Num -A-			CNH	284 136	120 700	-404 836	-	-	0.00
Wuliangye Yibin Co Ltd -A-			CNH	347 711	-	-347 711	-	-	0.00
Wuxi Apptec Co Ltd.			CNH	-	597 000	-597 000	-	-	0.00
Wuxi Apptec Co.. Ltd.			HKD	-	62 500	-62 500	-	-	0.00
Wuxi Biologics Rg			HKD	-	577 000	-577 000	-	-	0.00
Wuxi Longsheng-A Rg			CNH	-	216 900	-216 900	-	-	0.00
Xiaomi Corporation			HKD	-	741 200	-	741 200	1 564 542.99	0.74
Xinhua Winshare-A-			CNH	-	1 653 800	-1 653 800	-	-	0.00
Yadea Group Holdings Ltd			HKD	-	2 460 000	-1 670 000	790 000	998 709.37	0.47
Zeekr /Sadr			USD	-	9 323	-9 323	-	-	0.00
Zhaojin Mining Ind.-H-			HKD	1 014 000	614 500	-1 628 500	-	-	0.00
Zhejiang Dun An -A-			CNH	-	314 700	-314 700	-	-	0.00
Zhejiang Satellite Petrochem-A-			CNH	-	180 100	-180 100	-	-	0.00
Zhengzhou Yutong Bus Co -A-			CNH	-	2 908 800	-1 229 900	1 678 900	5 961 353.28	2.83
Zhuzhou Hua Rg-A			CNH	105 879	-	-105 879	-	-	0.00
Zijin Mining Group Co Ltd			CNH	3 838 000	3 501 000	-3 056 300	4 282 700	10 355 945.34	4.92
							206 370 129.83	98.11	
Anleihen									
Wuxi Biologics (Cayman) Inc. Usd 0.0	0.000	31.12.99	HKD	-	1 210	-1 210	-	-	0.00
									0.00
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind							206 370 129.83	98.11	
SUMME WERTPAPIERBESTAND							206 370 129.83	98.11	
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen							3 815 945.66	1.81	
Sonstige Aktiven							157 495.62	0.08	
GESAMTNETTOVERMÖGEN							210 343 571.11	100.00	

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus

Wertpapierbestand und sonstige Vermögenswerte per 30.06.2024

Bezeichnung	%	Verfall/ Fälligkeit	Währung	Anfangsbestand 01.07.2023	Käufe*	Verkäufe*	Schlussbestand 30.06.2024	Marktwert in CHF	% des Netto- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind									
Aktien									
Also Holding N Namen-Akt.			CHF	-	4 500	-	4 500	1 246 500.00	6.38
Ams-Osram Ag			CHF	-	90 000	-	90 000	112 005.00	0.57
Ascom Holding Ag /Nam.			CHF	-	20 000	-	20 000	153 000.00	0.78
Bachem Hldg N			CHF	-	14 000	-	14 000	1 154 300.00	5.91
Belimo Hldg N			CHF	-	1 700	-200	1 500	675 900.00	3.46
Bell Food Group Ag			CHF	-	2 950	-	2 950	764 050.00	3.91
Bobst Group Sa. Prilly /Nom.			CHF	-	7 000	-	7 000	469 000.00	2.40
Bossard Holding Ag			CHF	-	3 000	-	3 000	634 500.00	3.25
Bucher Industries Ag /Nam			CHF	-	750	-	750	271 500.00	1.39
Burkhalter Hldg			CHF	-	6 000	-	6 000	552 600.00	2.83
Comet Holding Ag			CHF	-	550	-	550	199 100.00	1.02
Cph Chemie & Papier /Reg			CHF	-	5 000	-	5 000	343 000.00	1.76
Daetwyler Holding Ag			CHF	-	4 450	-200	4 250	717 400.00	3.67
Dottikon Es Hldg Registered Shs			CHF	-	1 950	-	1 950	493 350.00	2.53
Ems Chemie Holding Ag			CHF	-	700	-	700	515 550.00	2.64
Forbo Holding Ag /Nam. *Opr*			CHF	-	550	-	550	575 300.00	2.94
Georg Fischer N			CHF	-	3 000	-	3 000	180 750.00	0.93
Gurit Hldg N			CHF	-	1 600	-	1 600	84 320.00	0.43
Huber + Suhner Ag /Nam			CHF	-	7 000	-1 000	6 000	459 000.00	2.35
Inficon Holding /Namenakt.			CHF	-	200	-	200	273 200.00	1.40
Interroll Holding Ltd/Nam.			CHF	-	200	-	200	530 000.00	2.71
Kaba Holding Ag Ruemlang			CHF	-	500	-	500	230 500.00	1.18
Klingelberg Ltd			CHF	-	10 400	-	10 400	184 600.00	0.94
Lem Holding /Nom.			CHF	-	500	-50	450	643 500.00	3.29
Lindt & Spruengli /Partiz			CHF	-	50	-	50	524 500.00	2.68
Logitech Intl Sa			CHF	-	7 500	-	7 500	651 900.00	3.34
Phoenix Mecano N			CHF	-	900	-	900	429 300.00	2.20
Pierer Mobility Ag			CHF	-	10 000	-	10 000	278 000.00	1.42
Schindler Holding /Partic			CHF	-	2 000	-	2 000	451 600.00	2.31
Schweiter Techn N			CHF	-	350	-	350	139 475.00	0.71
Sensirion Holding Ltd.			CHF	-	3 000	-	3 000	234 300.00	1.20
Sig Combibloc Group Ag			CHF	-	42 500	-	42 500	699 125.00	3.58
Sika Ltd			CHF	-	4 200	-200	4 000	1 028 800.00	5.27
Skan Group N			CHF	-	11 000	-	11 000	877 800.00	4.49
Stadler Rail Ag			CHF	-	21 000	-	21 000	536 550.00	2.75
Vat Group Ltd			CHF	-	800	-	800	407 520.00	2.09
Ypsomed Holding Ag			CHF	-	1 200	-	1 200	484 800.00	2.48
							18 206 595.00	93.19	
Summe Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind								18 206 595.00	93.19

* Käufe und Verkäufe (ungeprüft) umfassen die folgenden Transaktionen:
Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten/Umwandlungen/Namensänderungen/Titelaufteilungen/Übertragungen/Umtausch zwischen
Gesellschaften/Gratistiteln/Käufen/„Splits“/Stock/Wahldividenden/Exit infolge von Verfall/Auslosungen/„Reversesplits“/Rückzahlungen/Verkäufen

JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus (Fortsetzung)

		01.07.2023		Schlussbestand 30.06.2024		CHF	
Sonstige übertragbare Wertpapiere							
Aktien							
Perlen Industrh N	CHF	-	5 000	-	5 000	115 000.00	0.59
						115 000.00	0.59
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere						115 000.00	0.59
SUMME WERTPAPIERBESTAND						18 321 595.00	93.78
Liquide Mittel inklusive Geldmarktanlagen						1 238 039.15	6.34
Sonstige Passiven						-22 115.32	-0.12
GESAMTNETTOVERMÖGEN						19 537 518.83	100.00

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2024

1. Gründung der Gesellschaft

JSS Investmentfonds (die „Gesellschaft“) ist eine offene Investmentgesellschaft (société d'investissement à capital variable - SICAV), die auf der Grundlage von Teil I des geänderten Gesetzes vom 17.12.2010 (das geänderte „Gesetz von 2010“) in der jeweils geltenden Fassung als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) gegründet wurde. Die Gesellschaft hat J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A., welche als Verwaltungsgesellschaft gemäß Kapitel 15 des Gesetzes von 2010 in seiner geänderten Fassung zugelassen ist, als ihre Verwaltungsgesellschaft ernannt.

Die Gesellschaft ist eine Anlagegesellschaft mit verschiedenen Teilfonds (Auflegungsdatum):

- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG (30.09.2014)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets (05.06.1996)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - Global Dividend (29.10.2010)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) (05.07.1995)
- JSS Investmentfonds - JSS Twelve Sustainable Insurance Bond (31.10.2014)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - Global Thematic (30.09.2005)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Bond - Global Short-term (31.07.2014)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Bond CHF (31.01.2001)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Bond - Euro Broad (06.01.2003)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Bond - EUR Corporates (02.09.1992)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - Europe (26.02.1993)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035 (01.06.1999)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - Real Estate Global (02.04.2007)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - USA (29.10.2010)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities (16.02.1994)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - Green Planet (27.12.2007)
- JSS Investmentfonds - JSS Bond - USD High Yield (30.03.2015)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Bond - Total Return Global (30.12.2015)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer (31.05.2018)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors (31.05.2018)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency (19.06.2019)
- JSS Investmentfonds - JSS Equity - All China (17.12.2019)
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus (20.12.2023)

Die Gesellschaft hat während des Geschäftsjahres drei Teilfonds zusammengelegt:

- JSS Investmentfonds II - Sustainable Bond - Asia Opportunities wurde zum 03.07.2023 mit dem JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG zusammengelegt.
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF) wurde zum 25.10.2023 mit dem JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities zusammengelegt.
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR) wurde zum 02.11.2023 mit dem JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) zusammengelegt.
- JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus wurde zum 20.12.2023 aufgelegt.

Eine Liste aller derzeit ausgegebenen Aktienklassen finden Sie im Abschnitt Informationen am Anfang des Berichts.

2. Wichtige Buchführungsgrundsätze

Darstellung des Abschlusses

Die Abschlüsse der Gesellschaft werden in Übereinstimmung mit den in Luxemburg allgemein anerkannten Grundsätzen der Rechnungslegung und den luxemburgischen Vorschriften betreffend Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren erstellt.

Die konsolidierten Zahlen wurden nicht um Überkreuzinvestitionen von Teilfonds bereinigt. Per 30.06.2024 beliefen sich die Teilfonds-Überkreuzinvestitionen des Teilfonds JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities auf insgesamt 10 383 765.21 EUR. Somit liegt der konsolidierte NIW zum Ende des Jahres ohne Überkreuzinvestitionen insgesamt bei 4 817 234 227.86 EUR.

a) Umrechnung von Fremdwährungen

Die Anlagen ebenso wie andere Vermögenswerte und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen werden zum Wechselkurs vom 30.06.2024 umgerechnet. Fremdwährungsgeschäfte während des Jahres werden zu den am Tag der Transaktion geltenden Wechselkursen umgerechnet. Realisierte Nettogewinne und -verluste und die Nettoveränderungen der nicht realisierten Wertsteigerungen und Wertminderungen werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und in den Veränderungen des Netto-Fondsvermögens der einzelnen Teilfonds ausgewiesen.

b) Wertpapieranlagen

Wertpapiere, die an einer Börse oder einem anderen regulierten Zweitmarkt gehandelt werden, werden zum letzten bekannten Preis bewertet. Sofern im Wertpapierbestand enthaltene Wertpapiere weder an einer Börse notiert noch auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden oder der erhaltene Preis nicht repräsentativ oder angemessen ist, wird das betreffende Wertpapier aufgrund eines vom Verwaltungsrat der Gesellschaft nach Treu und Glauben festgelegten, angemessenen und zu erwartenden Verkaufspreises bewertet.

c) Investmentfonds

Aktien oder Anteile an offenen Investmentfonds werden auf der Grundlage ihres zuletzt verfügbaren Nettoinventarwertes oder gemäß obigem Absatz b) zum Preis am Ort ihrer Notierung bewertet.

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2024 (Fortsetzung)

2. Wichtige Buchführungsgrundsätze (Fortsetzung)

d) Devisentermingeschäfte

Devisentermingeschäfte werden zu den Terminmarktsätzen für die verbleibende Zeitdauer vom Bewertungsstichtag bis zur Fälligkeit des Kontrakts bewertet. Nicht realisierte Gewinne oder Verluste, welche sich zum Stichtag aus der Bewertung offener Devisentermingeschäfte ergeben, sind in der Nettovermögensaufstellung berücksichtigt; die realisierten Nettogewinne und -verluste sowie Veränderungen bei nicht realisierten Nettogewinnen und -verlusten sind in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens aufgeführt.

e) Optionsgeschäfte

Optionsgeschäfte werden zu dem Marktpreis zum Bewertungsstichtag bewertet. Nicht realisierte Gewinne oder Verluste, welche sich zum Stichtag aus der Bewertung von Optionen ergeben, sind in der Nettovermögensaufstellung berücksichtigt; die realisierten Nettogewinne und -verluste sowie Nettoveränderungen bei nicht realisierten Gewinnen und Verlusten sind in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens aufgeführt.

f) Terminkontrakte

Terminkontrakte werden zu dem der jeweiligen Restlaufzeit entsprechenden Marktpreis zum Bewertungsstichtag bewertet. Nicht realisierte Nettogewinne oder -verluste, die sich zum Stichtag aus der Bewertung offener Terminkontrakte ergeben, sind in der Nettovermögensaufstellung berücksichtigt; die realisierten Nettogewinne und -verluste sowie Veränderungen bei nicht realisierten Nettogewinnen und -verlusten sind in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens aufgeführt.

g) CFD-Kontrakte (Contracts for difference)

CFD-Kontrakte werden durch den Marktpreis des jeweiligen zugrunde liegenden Wertpapiers (Underlying) zum Bewertungsstichtag bewertet. Nicht realisierte Gewinne oder Verluste, die sich zum Stichtag aus der Bewertung offener CFD-Kontrakte ergeben, sind in der Nettovermögensaufstellung berücksichtigt; die realisierten Nettogewinne und -verluste sowie Veränderungen bei unrealisierten Nettogewinnen und -verlusten sind in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens aufgeführt. Sofern im Wertpapierbestand enthaltene Derivate weder an einer Börse notiert noch auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden oder sofern der wie oben beschrieben erhaltene Preis nicht repräsentativ ist oder keinen angemessenen Marktpreis des Derivates darstellt, wird das betreffende Derivat aufgrund eines nach Treu und Glauben berechneten, angemessenen und zu erwartenden Verkaufspreises bewertet. Die Zinsen im Zusammenhang mit den CFD-Kontrakten werden unter den sonstigen Erträgen bzw. den sonstigen Aufwendungen erfasst.

h) Swaps

Swap-Transaktionen werden in der Regel auf Grundlage der von der Gegenpartei der jeweiligen Swap-Transaktion erhaltenen Bewertungen bewertet. Bei diesen Werten kann es sich um Geld-, Brief- oder Mittelkurse handeln, die gemäß den vom Verwaltungsrat der Gesellschaft festgelegten Verfahren nach Treu und Glauben bestimmt werden können. Sollte der Verwaltungsrat der Gesellschaft der Auffassung sein, dass diese Werte nicht dem realen Marktwert der betreffenden Swap-Transaktionen entsprechen, so wird ihr Wert durch den Verwaltungsrat der Gesellschaft nach Treu und Glauben oder gemäß einer anderen Methode bestimmt, die dieser als angemessen erachtet.

i) Rundungsdifferenzen

Aus rechnerischen Gründen können in den Tabellen in diesem Jahresbericht, einschließlich des geprüften Abschlusses, Rundungsdifferenzen (Einheit, % usw.) auftreten.

j) Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus dem Wertpapierportfolio

Der aus dem Wertpapierportfolio realisierte Nettogewinn/(-verlust) wird auf Grundlage der Durchschnittskosten der verkauften Wertpapieranlagen ermittelt.

k) Konsolidierte Zahlen

Die konsolidierten Zahlen der Gesellschaft lauten auf EUR und umfassen, ggf. umgerechnet, alle Abschlüsse der einzelnen Teilfonds.

l) Erträge aus Wertpapieranlagen

Dividenden werden am Ex-Dividendendatum als Erträge erfasst. Zinserträge laufen täglich auf.

3. Nettoinventarwert

a) Berechnung

Der Nettoinventarwert pro Aktie lautet auf die Währung des betreffenden Teilfonds und wird täglich berechnet, indem das Netto-Fondsvermögen des betreffenden Teilfonds durch die Anzahl ausgegebener und umlaufender Aktien des Teilfonds dividiert wird. Der Nettoinventarwert des Teilfonds am Tag T ist auf Basis der Marktpreise vom Tag T berechnet, wird aber am Tag T+1 publiziert. Die Einstandskosten von verkauften Wertpapieren werden nach der Methode des gewichteten Durchschnittspreises berechnet.

b) Rücknahme von Aktien

Der Aktionär eines Teilfonds ist jederzeit berechtigt, die Rücknahme seiner Aktien zum Nettoinventarwert pro Aktie zu verlangen, abzüglich einer Rücknahmegebühr von maximal 0.40% (Verwässerungsgebühr).

c) Ausgabe von Aktien

Der Zeichnungskurs wird wie folgt berechnet:

- Nettoinventarwert pro Aktie des betreffenden Teilfonds
- Kommission von max. 3.00% für die mit der Platzierung und dem Verkauf betraute Vertriebsstelle.

d) Umwandlung von Aktien

Der Aktionär ist berechtigt, zwischen den Teilfonds gemäß den im ausführlichen und vereinfachten Verkaufsprospekt enthaltenen Bedingungen hin und her zu wechseln.

e) Single Swing Pricing

Ergibt sich an einem beliebigen Handelstag aus der Summe der Zeichnungen oder Rücknahmen aller Aktienklassen eines Teilfonds ein Nettokapitalzufluss oder -abfluss, kann sich der Nettoinventarwert des betreffenden Teilfondsvermögens an diesem Handelstag erhöhen oder reduzieren (Single Swing Pricing). Diese Anpassung führt zu einem Anstieg des Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einem Anstieg der Anzahl von Aktien des betreffenden Teilfonds führen. Sie führt zu einer Reduzierung des Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegungen zu einer Verringerung der Anzahl von Aktien führen.

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2024 (Fortsetzung)

3. Nettoinventarwert (Fortsetzung)

e) Single Swing Pricing (Fortsetzung)

Der maximale anwendbare Swing-Faktor gemäß dem Prospekt entspricht 3% des Nettoinventarwerts.

Der maximale Swing-Faktor, der während des Jahres angewendet wurde, betrug 0.51%.

Ein partieller Single Swing Pricing-Mechanismus wird angewendet, d. h. ein Single Swing Pricing wird nur angewendet, wenn der Nettokapitalzufluss/-abfluss einen vordefinierten Schwellenwert überschreitet.

Während des Geschäftsjahres wurde das Swing Pricing für alle Teilfonds angewandt, mit Ausnahme derjenigen, die während des Geschäftsjahres aufgelöst oder zusammengelegt wurden.

Am letzten Tag des Geschäftsjahres wurde kein Swing Pricing angewandt.

4. Taxe d'abonnement

Die Gesellschaft unterliegt im Rahmen der gesetzlichen Bestimmungen in Luxemburg einer jährlichen Steuer („Taxe d'abonnement“) von 0.05%, bzw. 0.01% für institutionelle Aktienklassen des Nettovermögens des Fonds, die vierteljährlich jeweils am Ende jedes Quartals zahlbar ist. Die Gesellschaft unterliegt keiner luxemburgischen Einkommens-, Kapitalgewinn- oder Quellensteuer. Die Gesellschaft zahlt keine Steuer auf den Teil des Nettovermögens des Fonds, welcher in anderen Organismen für gemeinsame Anlagen angelegt ist, die bereits im Einklang mit den luxemburgischen gesetzlichen Vorschriften der „Taxe d'abonnement“ unterliegen.

5. Verwaltungsgesellschaftsgebühr

Die folgenden Vergütungen der Verwaltungsgesellschaft stellen die Höchstsätze gemäß Prospekt dar und basieren auf dem an jedem Bewertungstag errechneten Wert des Nettovermögens des Teilfonds und sind vierteljährlich nachträglich zahlbar (zutreffend für alle Aktienklassen, falls nicht anderweitig vorgegeben):

Teilfonds	Klasse	ISIN	Maximale Verwaltungsgesellschaftsgebühr (%)
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-C CHF acc hedged-	LU1073944271	0.85%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-C EUR acc hedged-	LU1073944354	0.85%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-C USD acc-	LU1073944198	0.85%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-C USD dist-	LU1210450364	0.85%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-I CHF acc hedged-	LU1073944511	0.70%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-I USD acc-	LU1073944438	0.70%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-I USD dist-	LU1210450448	0.70%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-P CHF acc hedged-	LU1073943893	1.30%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-P EUR acc hedged-	LU1073943976	1.30%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-P EUR dist hedged-	LU1244594351	1.30%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-P USD acc-	LU1073943620	1.30%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-P USD dist-	LU1210450281	1.30%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y CHF acc hedged-	LU1201473821	1.00%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y CHF dist hedged-	LU1244594948	1.00%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y EUR acc hedged-	LU1201474043	1.00%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y EUR dist hedged-	LU1244595085	1.00%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y GBP dist hedged-	LU1545798859	1.00%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y USD acc-	LU1201474126	1.00%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	-Y USD dist-	LU1210450521	1.00%
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	-C USD acc-	LU0950588334	1.15%
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	-C USD dist-	LU1732170136	1.15%
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	-I USD acc-	LU1111702400	1.05%
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	-M USD acc-	LU1860229043	0.12%
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	-P USD dist-	LU0068337053	1.75%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C EUR acc-	LU0950588763	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C EUR dist-	LU1732170649	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C GBP acc-	LU1354468743	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C H1 GBP dist-	LU2592797984	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C USD acc-	LU1111702822	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-C USD dist-	LU2076226567	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-E USD acc-	LU2076227615	1.50%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-E USD dist-	LU2076227532	1.50%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-I USD acc-	LU1111703044	0.90%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-I10 EUR acc-	LU2569393635	0.90%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-M USD acc-	LU2076228340	0.12%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-P EUR acc-	LU0533812276	1.50%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-P EUR dist-	LU0375216479	1.50%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-P USD acc-	LU1096892549	1.50%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-P USD dist-	LU1732170565	1.50%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-S EUR acc-	LU1842717297	0.75%

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2024 (Fortsetzung)

5. Verwaltungsgesellschaftsgebühr (Fortsetzung)

Teilfonds	Klasse	ISIN	Maximale Verwaltungsgesellschaftsgebühr (%)
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-S EUR dist-	LU1842717370	0.75%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-Y EUR dist-	LU2076227706	1.25%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-Y USD acc-	LU2076228001	1.25%
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	-Y USD dist-	LU2076227961	1.25%
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	-C EUR acc-	LU0950589068	1.00%
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	-C EUR dist-	LU1732171027	1.00%
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	-P EUR acc-	LU2427701961	1.50%
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	-P EUR dist-	LU0058893917	1.50%
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	-S EUR acc-	LU1842716646	0.75%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-C CHF acc hedged-	LU1111708860	0.90%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-C EUR acc-	LU1111708787	0.90%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-C GBP acc hedged-	LU1111709082	0.90%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-C USD acc hedged-	LU1111708944	0.90%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I CHF acc hedged-	LU1111709322	0.80%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I EUR acc-	LU1111709249	0.80%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I USD acc hedged-	LU1111709595	0.80%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I USD dist hedged-	LU1244595754	0.80%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I10 CHF acc hedged-	LU2075973177	0.60%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I10 EUR acc-	LU2075973334	0.60%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I3 CHF acc hedged-	LU2075972286	0.70%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I30 CHF acc hedged-	LU1629314078	0.50%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I30 EUR acc-	LU1629313856	0.50%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I30 GBP dist hedged-	LU1629314581	0.50%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-I30 USD dist hedged-	LU1629314318	0.50%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ3 CHF acc hedged-	LU2075975206	0.70%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ3 EUR acc-	LU2075975461	0.70%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ3 EUR dist-	LU2075975545	0.70%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ10 USD acc hedged-	LU2075977087	0.60%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ10 CHF acc hedged-	LU2075976600	0.60%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-IZ10 GBP acc hedged-	LU2075977327	0.60%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-P CHF acc hedged-	LU1111708431	1.10%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-P EUR acc-	LU1111708357	1.10%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-P EUR dist-	LU1210451099	1.10%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-P USD acc hedged-	LU1111708514	1.10%
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	-P USD dist hedged-	LU1244595242	1.10%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-C CHF acc-	LU2076229074	1.25%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-C EUR acc-	LU0950589498	1.25%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-C EUR dist-	LU1732171373	1.25%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-C GBP acc-	LU2076229405	1.25%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-C USD acc-	LU1111703127	1.25%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I EUR acc-	LU0405184523	1.15%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I USD (BRL hedged) acc-	LU2067136072	1.15%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I USD acc-	LU1111703390	1.15%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I USD dist-	LU1991390706	1.15%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I10 CHF acc-	LU2008796604	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I10 EUR acc-	LU2008796273	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I10 USD acc-	LU2008796430	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-I30 CHF acc-	LU2427699371	0.90%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-IH1 NOK acc-	LU2076230247	1.15%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-M CHF acc-	LU2499280977	0.12%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-M EUR acc-	LU0950589571	0.12%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-P EUR acc-	LU0480508919	1.75%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-P EUR dist-	LU0229773345	1.75%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-P SGD acc-	LU2361429579	1.75%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-P USD acc-	LU1111703473	1.75%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-P USD dist-	LU1732171290	1.75%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-S EUR dist-	LU2076230833	0.75%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-Y EUR acc-	LU1205684001	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	-Y USD dist-	LU2161043588	1.00%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-C CHF acc hedged-	LU1073945245	0.75%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-C EUR acc hedged-	LU1073945328	0.75%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-C EUR dist hedged-	LU1244596133	0.75%

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2024 (Fortsetzung)

5. Verwaltungsgesellschaftsgebühr (Fortsetzung)

Teilfonds	Klasse	ISIN	Maximale Verwaltungsgesellschaftsgebühr (%)
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-C USD acc-	LU1073945161	0.75%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-C USD dist-	LU1210452063	0.75%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-I USD acc-	LU1073945591	0.65%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-P CHF acc hedged-	LU1073944941	1.00%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-P EUR acc hedged-	LU1073945088	1.00%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-P USD acc-	LU1073944867	1.00%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-P USD dist-	LU1210451842	1.00%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-Y CHF acc hedged-	LU1201473581	1.00%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-Y EUR acc hedged-	LU1201473664	1.00%
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	-Y USD dist-	LU1210452659	1.00%
JSS Sustainable Bond CHF	-C CHF acc-	LU0950591809	0.75%
JSS Sustainable Bond CHF	-I CHF acc-	LU2668234284	0.65%
JSS Sustainable Bond CHF	-M CHF acc-	LU0950591981	0.10%
JSS Sustainable Bond CHF	-P CHF dist-	LU0121751324	0.75%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-C CHF acc hedged-	LU2076224786	0.70%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-C EUR acc-	LU0950592104	0.70%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-C EUR dist-	LU1732171969	0.70%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-I EUR acc-	LU2076225163	0.70%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-I10 EUR acc-	LU2794641170	0.70%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-I30 EUR acc-	LU2783792133	0.70%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-P CHF dist hedged-	LU2076224273	1.00%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-P EUR acc-	LU2076223622	1.00%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-P EUR dist-	LU0158938935	1.00%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-Y CHF acc hedged-	LU2076226054	0.60%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-Y EUR acc-	LU1752454568	0.60%
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	-Y EUR dist-	LU1752454485	0.60%
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-C EUR acc-	LU0950591718	0.80%
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-C EUR dist-	LU1732172009	0.80%
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-I EUR acc-	LU0734492860	0.70%
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-M EUR acc-	LU0776582891	0.10%
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-P EUR dist-	LU0045164786	1.00%
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-Y CHF dist hedged-	LU2312587103	1.00%
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	-Y EUR acc-	LU1205683706	1.00%
JSS Sustainable Equity - Europe	-C EUR acc-	LU0950592369	1.15%
JSS Sustainable Equity - Europe	-I EUR acc-	LU1111704018	1.05%
JSS Sustainable Equity - Europe	-P EUR acc-	LU0484532444	1.75%
JSS Sustainable Equity - Europe	-P EUR dist-	LU0058891119	1.75%
JSS Sustainable Equity - Europe	-P USD acc-	LU1096900078	1.75%
JSS Sustainable Equity - Europe	-Y EUR acc-	LU1205683888	1.00%
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-C CHF acc-	LU2273127774	1.15%
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-C EUR acc-	LU0950592443	1.15%
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-C USD acc-	LU1111704364	1.15%
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-I EUR acc-	LU1111704521	1.05%
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-M CHF acc-	LU2499280894	0.12%
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-M EUR acc-	LU0749004452	0.12%
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-P EUR dist-	LU0097427784	1.75%
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	-P USD acc-	LU1111704448	1.75%
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-C EUR acc-	LU0950592872	1.00%
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-C EUR dist-	LU1991392827	1.00%
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-I EUR acc-	LU0950592955	0.90%
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-P EUR acc-	LU0288928376	1.50%
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-P EUR dist-	LU1991392074	1.50%
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	-P USD acc-	LU1111705098	1.50%
JSS Sustainable Equity - USA	-C USD acc-	LU0950593094	1.15%
JSS Sustainable Equity - USA	-I EUR acc hedged-	LU2729677927	1.05%
JSS Sustainable Equity - USA	-I USD dist-	LU2076232961	1.05%
JSS Sustainable Equity - USA	-I10 USD acc-	LU2427700138	1.00%
JSS Sustainable Equity - USA	-P USD acc-	LU0526864581	1.75%
JSS Sustainable Equity - USA	-P USD dist-	LU2076232706	1.75%
JSS Sustainable Equity - USA	-Y USD acc-	LU1629314664	1.00%
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-C CHF H2 acc-	LU1111702152	1.15%
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-C CHF H2 dist-	LU2273130307	1.15%

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2024 (Fortsetzung)

5. Verwaltungsgesellschaftsgebühr (Fortsetzung)

Teilfonds	Klasse	ISIN	Maximale Verwaltungsgesellschaftsgebühr (%)
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-C USD H2 dist-	LU2273130489	1.15%
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-C EUR acc-	LU0950593177	1.15%
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-I EUR acc-	LU1842720168	1.10%
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-I EUR dist-	LU1842720242	1.10%
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-I H2 CHF dist-	LU2273130562	1.10%
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-I USD H2 acc-	LU1842720325	1.10%
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-P CHF H2 acc-	LU1111702079	1.75%
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-P CHF H2 dist-	LU2273130133	1.75%
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-P EUR acc-	LU1111705338	1.75%
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-P EUR dist-	LU0058892943	1.75%
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	-P USD H2 acc-	LU1842719665	1.75%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-C CHF H1 acc-	LU1111702236	1.35%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-C EUR acc-	LU0950593250	1.35%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-C EUR dist-	LU1732172694	1.35%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-C USD acc-	LU1111705684	1.35%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-C USD dist-	LU1732172777	1.35%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-I CHF acc-	LU1965939850	1.25%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-I EUR acc-	LU0333595519	1.25%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-I EUR dist-	LU1732172850	1.25%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-I USD acc-	LU1111705411	1.25%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-I10 EUR acc-	LU2427703074	1.10%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P CHF H1 acc -	LU1111702319	2.00%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P EUR acc-	LU0707700596	2.00%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P EUR dist-	LU0333595436	2.00%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P GBP dist-	LU1545800341	2.00%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P USD H1 acc-	LU1120832198	2.00%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-P USD dist-	LU0950593417	2.00%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-S EUR dist-	LU1842716729	1.00%
JSS Sustainable Equity - Green Planet	-Y EUR acc-	LU1205684183	1.00%
JSS Bond - USD High Yield	-C EUR acc hedged-	LU1184841341	1.30%
JSS Bond - USD High Yield	-C USD acc-	LU1184840962	1.30%
JSS Bond - USD High Yield	-C USD dist-	LU1210450109	1.30%
JSS Bond - USD High Yield	-I USD (BRL hedged) acc-	LU2663598295	1.00%
JSS Bond - USD High Yield	-I USD acc-	LU1184841770	1.00%
JSS Bond - USD High Yield	-I USD dist-	LU1210450018	1.00%
JSS Bond - USD High Yield	-P CHF acc hedged-	LU1184840293	1.50%
JSS Bond - USD High Yield	-P CHF dist hedged-	LU1184840459	1.50%
JSS Bond - USD High Yield	-P EUR acc hedged-	LU1184840533	1.50%
JSS Bond - USD High Yield	-P EUR dist hedged-	LU1184840707	1.50%
JSS Bond - USD High Yield	-P USD acc-	LU1184840020	1.50%
JSS Bond - USD High Yield	-P USD dist-	LU1210449945	1.50%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-C CHF acc hedged-	LU1332517405	0.90%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-C EUR acc hedged-	LU1332517660	0.90%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-C USD acc-	LU1332517231	0.90%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-C USD dist-	LU1332517314	0.90%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-I CHF acc hedged-	LU1332518122	0.70%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-I EUR acc hedged-	LU1332518478	0.70%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-I EUR dist hedged-	LU1332518551	0.70%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-I USD acc-	LU1332517827	0.70%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-I USD dist-	LU1332518049	0.70%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-M CHF acc hedged-	LU1332518635	0.12%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-P CHF acc hedged-	LU1332516852	1.40%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-P EUR acc hedged-	LU1332517074	1.40%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-P EUR dist hedged-	LU1332517157	1.40%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-P USD acc-	LU1332516696	1.40%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-P USD dist-	LU1332516779	1.40%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-Y CHF acc hedged-	LU1405747244	1.00%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-Y EUR acc hedged-	LU1405747327	1.00%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-Y GBP dist hedged-	LU1405749539	1.00%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-Y USD acc-	LU1405747087	1.00%
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	-Y USD dist-	LU1405747160	1.00%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-C EUR acc-	LU1752455532	1.50%

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2024 (Fortsetzung)

5. Verwaltungsgesellschaftsgebühr (Fortsetzung)

Teilfonds	Klasse	ISIN	Maximale Verwaltungsgesellschaftsgebühr (%)
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-C EUR dist	LU1752455615	1.50%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-C USD acc	LU1752455375	1.50%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-E EUR acc	LU2161045799	1.60%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-E EUR dist	LU2161045872	1.60%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-I USD acc	LU1752455888	1.25%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-P EUR acc	LU1752454998	1.75%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-P EUR dist	LU1752455292	1.75%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-P USD acc	LU1752454642	1.75%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-P USD dist	LU1752454725	1.75%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-Y USD acc	LU1752456001	1.25%
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	-Y USD dist	LU1752456266	1.25%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-C CHF acc	LU1842718345	1.50%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-C EUR acc	LU1752454705	1.50%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-C USD acc	LU1752456936	1.50%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-C USD dist	LU1752457157	1.50%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-E USD acc	LU1842717453	1.75%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-E USD dist	LU1842717537	1.75%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-I CHF acc	LU1842718691	1.00%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-I USD (BRL hedged) acc	LU1842717883	1.00%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-I USD acc	LU1752458551	1.00%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-I10 USD acc	LU2273126701	0.90%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-M USD acc	LU1842718006	0.12%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-P CHF dist	LU1842718261	1.75%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-P EUR acc	LU1752456696	1.75%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-P EUR dist	LU1752456852	1.75%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-P USD acc	LU1752456340	1.75%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-P USD dist	LU1752456423	1.75%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-Y USD acc	LU1752458049	1.25%
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	-Y USD dist	LU1752458478	1.25%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-C USD acc	LU1835934479	1.30%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-C USD dist	LU1835934552	1.30%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-I USD acc	LU1835934636	1.00%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-I USD dist	LU1835934719	1.00%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-M USD acc	LU1835935013	0.12%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-P USD acc	LU1835934123	1.75%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-P USD dist	LU1835934396	1.75%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-Y USD acc	LU1835934800	1.00%
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	-Y USD dist	LU1835934982	1.00%
JSS Equity - All China	-C CHF acc	LU1965940783	1.50%
JSS Equity - All China	-C EUR acc	LU1965940510	1.50%
JSS Equity - All China	-C USD acc	LU1900873875	1.50%
JSS Equity - All China	-C USD dist	LU1900873958	1.50%
JSS Equity - All China	-I CHF acc	LU1965941161	1.25%
JSS Equity - All China	-I EUR acc	LU1965940940	1.25%
JSS Equity - All China	-I USD acc	LU1900874097	1.25%
JSS Equity - All China	-I10 USD acc	LU2273125992	1.10%
JSS Equity - All China	-P CHF acc	LU1965940353	2.00%
JSS Equity - All China	-P CHF dist	LU1965940437	2.00%
JSS Equity - All China	-P EUR acc	LU1965940197	2.00%
JSS Equity - All China	-P USD acc	LU1900873529	2.00%
JSS Equity - All China	-P USD dist	LU1900873792	2.00%
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus	-C CHF acc	LU2611736625	1.30%
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus	-C EUR acc	LU2611736971	1.30%
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus	-C USD acc hedged	LU2611736112	1.30%
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus	-I CHF acc	LU2611735734	1.20%
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus	-P CHF acc	LU2611734414	1.75%

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2024 (Fortsetzung)

6. Verwahrstellengebühren

Die Verwahrstelle wird gemäß den normalen Bankusancen in Luxemburg entschädigt.

7. Dividendenpolitik

Die Gesellschaft hat entschieden, für das Geschäftsjahr auf folgende ausschüttende Aktien eine Dividende auszuzahlen.

	Aktienklasse	ISIN	Währung	Betrag
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	C USD dist	LU1210450364	USD	1.56
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	I USD dist	LU1210450448	USD	1.60
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	P USD dist	LU1210450281	USD	1.34
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	P EUR dist hedged	LU1244594351	EUR	1.23*
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	Y USD dist	LU1210450521	USD	1.57
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	Y CHF dist hedged	LU1244594948	CHF	1.64*
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	Y EUR dist hedged	LU1244595085	EUR	1.62*
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	Y GBP dist hedged	LU1545798859	GBP	1.90*
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	C EUR dist	LU1732170649	EUR	1.99*
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	C USD dist	LU2076226567	USD	1.53
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	E USD dist	LU2076227532	USD	1.42
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	P EUR dist	LU0375216479	EUR	2.50*
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	P USD dist	LU1732170565	USD	0.97
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	S EUR dist	LU1842717370	EUR	2.48*
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	Y EUR dist	LU2076227706	EUR	1.08*
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	Y USD dist	LU2076227961	USD	2.87
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	I USD dist hedged	LU1244595754	USD	4.09*
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	IZ3 EUR dist	LU2075975545	EUR	3.79
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	I30 GBP dist hedged	LU1629314581	GBP	4.62*
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	P EUR dist	LU1210451099	EUR	3.18
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	P USD dist hedged	LU1244595242	USD	3.58*
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	C USD dist	LU1210452063	USD	1.67
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	C EUR dist hedged	LU1244596133	EUR	1.75*
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	P USD dist	LU1210451842	USD	1.62
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	Y USD dist	LU1210452659	USD	1.82
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	C EUR dist	LU1732172009	EUR	1.30
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	P EUR dist	LU0045164786	EUR	1.80
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	Y CHF dist hedged	LU2312587103	CHF	1.42*
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	C EUR dist	LU1991392827	EUR	1.25
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	P EUR dist	LU1991392074	EUR	0.87
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	I EUR dist	LU1842720242	EUR	1.28
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	I CHF dist	LU2273130562	CHF	1.19*
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	P EUR dist	LU0058892943	EUR	1.11
JSS Bond - USD High Yield	C USD dist	LU1210450109	USD	2.49
JSS Bond - USD High Yield	I USD dist	LU1210450018	USD	2.61
JSS Bond - USD High Yield	P EUR dist hedged	LU1184840707	EUR	2.18*
JSS Bond - USD High Yield	P CHF dist hedged	LU1184840459	CHF	2.16*
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	P USD dist	LU1332516779	USD	1.86
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	P EUR dist hedged	LU1332517157	EUR	1.60*
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	Y USD dist	LU1405747160	USD	1.23
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	Y GBP dist hedged	LU1405749539	GBP	1.40*
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	C USD dist	LU1835934552	USD	2.12
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	I USD dist	LU1835934719	USD	2.35
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	P USD dist	LU1835934396	USD	1.91
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	Y USD dist	LU1835934982	USD	2.32

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2024 (Fortsetzung)

7. Dividendenpolitik (Fortsetzung)

*Die Ausschüttungsbeträge in Teilfondswährung werden umgerechnet und zum Wechselkurs vom 05.10.2023 (Ex-Tag) in der Währung der Aktienklasse ausgezahlt.

	Aktienklasse	ISIN	Währung	Betrag
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	C USD dist	LU1210450364	USD	1.53
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	I USD dist	LU1210450448	USD	1.56
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	P EUR dist hedged	LU1244594351	EUR	1.21**
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	P USD dist	LU1210450281	USD	1.33
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	Y CHF dist hedged	LU1244594948	CHF	1.60**
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	Y EUR dist hedged	LU1244595085	EUR	1.56**
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	Y GBP dist hedged	LU1545798859	GBP	1.87**
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	Y USD dist	LU1210450521	USD	1.53
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	C EUR dist hedged	LU1244596133	EUR	1.69**
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	C USD dist	LU1210452063	USD	1.63
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	P USD dist	LU1210451842	USD	1.59
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	Y USD dist	LU1210452659	USD	1.78
JSS Bond - USD High Yield	C USD dist	LU1210450109	USD	2.22
JSS Bond - USD High Yield	I USD dist	LU1210450018	USD	2.33
JSS Bond - USD High Yield	P EUR dist hedged	LU1184840707	EUR	1.93**
JSS Bond - USD High Yield	P CHF dist hedged	LU1184840459	CHF	1.95**
JSS Bond - USD High Yield	P USD dist	LU1210449945	USD	2.02
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	C USD dist	LU1332517314	USD	0.86
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	I USD dist	LU1332518049	USD	0.95
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	I EUR dist hedged	LU1332518551	EUR	0.90**
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	P EUR dist hedged	LU1332517157	EUR	0.68**
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	P USD dist	LU1332516779	USD	0.78
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	Y GBP dist hedged	LU1405749539	GBP	1.16**
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	Y USD dist	LU1405747160	USD	1.01
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	C USD dist	LU1835934552	USD	1.72
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	I USD dist	LU1835934719	USD	1.90
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	P USD dist	LU1835934396	USD	1.53
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	Y USD dist	LU1835934982	USD	1.89

*Die Ausschüttungsbeträge in Teilfondswährung werden umgerechnet und zum Wechselkurs vom 19.03.2024 (Ex-Tag) in der Währung der Aktienklasse ausgezahlt.

	Aktienklasse	ISIN	Währung	Betrag
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	C USD dist	LU1210450364	USD	1.75
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	I USD dist	LU1210450448	USD	1.79
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	P USD dist	LU1210450281	USD	1.53
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	P EUR dist hedged	LU1244594351	EUR	1.39***
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	Y USD dist	LU1210450521	USD	1.75
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	Y CHF dist hedged	LU1244594948	CHF	1.80***
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	Y EUR dist hedged	LU1244595085	EUR	1.77***
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	Y GBP dist hedged	LU1545798859	GBP	2.16***
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	C EUR dist	LU1732170649	EUR	2.04***
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	C USD dist	LU2076226567	USD	1.57
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	C GBP H1 dist	LU2592797984	GBP	1.84
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	E USD dist	LU2076227532	USD	1.43
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	P USD dist	LU1732170565	USD	0.96
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	P EUR dist	LU0375216479	EUR	2.47***
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	S EUR dist	LU1842717370	EUR	2.56***
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	Y USD dist	LU2076227961	USD	2.97
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	Y EUR dist	LU2076227706	EUR	2.07***
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	I USD dist	LU1244595754	USD	4.05***
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	IZ3 EUR dist	LU2075975545	EUR	3.85
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	P EUR dist	LU1210451099	EUR	3.23
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	P USD dist hedged	LU1244595242	USD	3.59***
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	C USD dist	LU1210452063	USD	1.76
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	C EUR dist hedged	LU1244596133	EUR	1.81***
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	P USD dist	LU1210451842	USD	1.73
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	Y USD dist	LU1210452659	USD	1.91
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	C EUR dist	LU1732171969	EUR	1.11
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	P EUR dist	LU0158938935	EUR	1.10
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	P CHF dist hedged	LU2076224273	CHF	0.88***
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	Y EUR dist	LU1752454485	EUR	1.19
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	C EUR dist	LU1732172009	EUR	1.87

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2024 (Fortsetzung)

7. Dividendenpolitik (Fortsetzung)

	Aktienklasse	ISIN	Währung	Betrag
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	P EUR dist	LU0045164786	EUR	2.75
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	Y CHF dist hedged	LU2312587103	CHF	2.00***
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	C EUR dist	LU1991392827	EUR	1.61
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	P EUR dist	LU1991392074	EUR	1.27
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	C USD H2 dist	LU2273130489	USD	1.00***
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	I CHF H2 dist	LU2273130562	CHF	1.29***
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	P EUR dist	LU0058892943	EUR	1.29
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	P CHF H2 dist	LU2273130133	CHF	2.02***
JSS Bond - USD High Yield	C USD dist	LU1210450109	USD	2.37
JSS Bond - USD High Yield	I USD dist	LU1210450018	USD	2.50
JSS Bond - USD High Yield	P EUR dist hedged	LU1184840707	EUR	2.04***
JSS Bond - USD High Yield	P CHF dist hedged	LU1184840459	CHF	2.04***
JSS Bond - USD High Yield	P USD dist	LU1210449945	USD	2.17
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	C USD dist	LU1332517314	USD	0.89
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	I USD dist	LU1332518049	USD	0.99
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	I EUR dist hedged	LU1332518551	EUR	0.93***
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	Y USD dist	LU1405747160	USD	1.04
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	Y GBP dist hedged	LU1405749539	GBP	1.22***
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	C USD dist	LU1835934552	USD	1.47
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	I USD dist	LU1835934719	USD	1.68
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	P USD dist	LU1835934396	USD	1.29
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	Y USD dist	LU1835934982	USD	1.66

***Die Ausschüttungsbeträge in Teilfondswährung werden umgerechnet und zum Wechselkurs vom 03.10.2024 (Ex-Tag) in der Währung der Aktienklasse ausgezahlt.

8. Total Expense Ratio (TER)

Die TER wurde gemäß der „Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der TER“ des Schweizerischen Anlagefondsverbands („Swiss Funds and Asset Management Association“, „SFAMA“) in der Fassung vom 20.04.2015 ermittelt.

Abhängig von den Umständen sind die Transaktionskosten entweder im Kaufpreis der Wertpapiere enthalten und/oder gesondert in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Veränderung des Nettovermögens ausgewiesen. Diese Kosten, die gemäß oben genannter Richtlinie nicht zum Betriebsaufwand gehören (vgl. Ziffer 3 der Richtlinie), werden damit nicht bei der TER-Berechnung berücksichtigt.

9. Devisentermingeschäfte

Folgende Devisentermingeschäfte standen zum 30.06.2024 offen:

Gegenparteien: Bank J. Safra Sarasin Ltd, CACEIS Investor Services Bank S.A., Royal Bank of Canada London, The Bank of New York Mellon S.A. und HSBC Bank Plc.

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG

Kaufwährung	Kaufbetrag	Verkaufswährung	Verkaufsbetrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) (in USD)
EUR	32 603	USD	34 826	01.07.2024	120.57
CHF	2 658	USD	2 963	02.07.2024	-4.07
EUR	155 326	USD	166 391	02.07.2024	105.62
CHF	27 018 805	USD	30 463 740	12.09.2024	-112 570.09
EUR	50 628 454	USD	54 725 484	12.09.2024	-261 063.84
GBP	3 741 081	USD	4 763 453	12.09.2024	-31 651.61
USD	36 200	CHF	31 967	12.09.2024	287.71
USD	1 513 955	EUR	1 404 400	12.09.2024	3 135.70
USD	12 577	GBP	9 886	12.09.2024	72.48
USD	28 872 890	EUR	26 500 000	27.09.2024	343 366.73
					-58 200.80

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2024 (Fortsetzung)

9. Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets

Kaufwährung	Kaufbetrag	Verkaufswährung	Verkaufsbetrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Netto(verlust) (in USD)
USD	3 984	INR	332 383	01.07.2024	-0.93
					-0.93

JSS Sustainable Equity - Global Dividend

Kaufwährung	Kaufbetrag	Verkaufswährung	Verkaufsbetrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) (in USD)
CAD	2 249	GBP	1 291	12.07.2024	11.43
EUR	31 493	GBP	26 650	12.07.2024	84.85
GBP	41 204	CAD	70 606	12.07.2024	472.45
GBP	77 689	CHF	87 621	12.07.2024	547.71
GBP	19 454	DKK	168 505	12.07.2024	356.29
GBP	270 190	EUR	313 426	12.07.2024	5 424.46
GBP	21 394	SEK	289 953	12.07.2024	-351.18
GBP	787 677	USD	986 939	12.07.2024	8 800.21
SEK	28 211	GBP	2 113	12.07.2024	-5.29
USD	34 598	GBP	27 158	12.07.2024	265.90
					15 606.83

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)

Kaufwährung	Kaufbetrag	Verkaufswährung	Verkaufsbetrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) (in EUR)
EUR	1 918	JPY	330 271	01.07.2024	1.67
EUR	2 822	USD	3 024	08.07.2024	1.86
EUR	14 334 959	USD	15 428 000	19.09.2024	-1 752.16
					-1 748.63

JSS Twelve Sustainable Insurance Bond

Kaufwährung	Kaufbetrag	Verkaufswährung	Verkaufsbetrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) (in EUR)
EUR	136 541 127	GBP	115 526 000	31.07.2024	472 607.92
EUR	7 209 971	USD	7 730 000	31.07.2024	9 085.87
CHF	160 645 459	EUR	166 100 140	05.09.2024	1 569 059.63
EUR	139 311	CHF	133 253	05.09.2024	231.17
EUR	9 874	USD	10 644	05.09.2024	-23.56
GBP	1 733 989	EUR	2 029 947	05.09.2024	9 336.59
USD	36 279 346	EUR	33 221 505	05.09.2024	513 699.75
					2 573 997.37

JSS Sustainable Equity - Global Thematic

Kaufwährung	Kaufbetrag	Verkaufswährung	Verkaufsbetrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) (in EUR)
EUR	56 835	JPY	9 787 596	01.07.2024	49.50
EUR	2 549 047	USD	2 733 562	01.07.2024	-1 254.73
EUR	76 160	USD	81 609	08.07.2024	49.96
BRL	325 938 215	USD	62 995 281	15.07.2024	-4 136 515.29
USD	2 941 675	BRL	15 630 775	15.07.2024	124 593.05
					-4 013 077.51

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2024 (Fortsetzung)

9. Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

Die folgenden Devisenterminkontrakte wurden vor Fälligkeit glattgestellt, da sie mit einer Anteilsklasse verbunden waren, die vor dem 30.06.2024 aufgelöst wurde. Die damit verbundenen realisierten Ergebnisse aus der Glattstellung dieser Kontrakte werden unter den Posten „Verbindlichkeiten/Forderungen aus Finanzinstrumenten“ in der Nettovermögensaufstellung ausgewiesen.

Kaufwährung	Kaufbetrag	Verkaufswährung	Verkaufsbetrag	Fälligkeit
EUR	56 835	JPY	9 787 596	01.07.2024
EUR	2 549 048	USD	2 733 562	01.07.2024
EUR	76 160	USD	81 609	08.07.2024
EUR	2 631 527	NOK	30 142 987	12.07.2024
GBP	1 070 524	NOK	14 437 255	12.07.2024
HKD	2 061 573	NOK	2 790 567	12.07.2024
JPY	80 753 616	NOK	5 477 989	12.07.2024
NOK	30 747 998	EUR	2 631 527	12.07.2024
NOK	14 534 148	GBP	1 070 525	12.07.2024
NOK	2 861 024	HKD	2 061 574	12.07.2024
NOK	5 671 204	JPY	80 753 616	12.07.2024
NOK	113 767 817	USD	10 513 094	12.07.2024
USD	10 513 095	NOK	111 309 776	12.07.2024
BRL	325 938 215	USD	62 995 281	15.07.2024
USD	3 711 353	BRL	19 913 560	15.07.2024

JSS Sustainable Bond - Global Short-term

Kaufwährung	Kaufbetrag	Verkaufswährung	Verkaufsbetrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) (in USD)
CHF	4 850 498	USD	5 468 906	12.09.2024	-20 171.25
EUR	25 386 232	USD	27 441 145	12.09.2024	-131 475.30
USD	53 079	EUR	49 245	12.09.2024	102.44
USD	2 325 581	CHF	2 050 000	27.09.2024	18 552.11
USD	18 740 140	EUR	17 200 000	27.09.2024	222 864.44
					89 872.44

JSS Sustainable Bond - Euro Broad

Kaufwährung	Kaufbetrag	Verkaufswährung	Verkaufsbetrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Nettogewinn (in EUR)
CHF	20 072 950	EUR	20 643 984	15.07.2024	222 631.16
					222 631.16

JSS Sustainable Bond - EUR Corporates

Kaufwährung	Kaufbetrag	Verkaufswährung	Verkaufsbetrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) (in EUR)
CHF	12 735 478	EUR	13 168 335	05.09.2024	120 996.48
EUR	18 369	CHF	17 657	05.09.2024	-55.48
					120 941.00

JSS Sustainable Equity - Real Estate Global

Kaufwährung	Kaufbetrag	Verkaufswährung	Verkaufsbetrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Nettogewinn (in EUR)
EUR	19 569	JPY	3 370 039	01.07.2024	17.04
					17.04

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2024 (Fortsetzung)

9. Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

JSS Sustainable Equity - USA

Kaufwährung	Kaufbetrag	Verkaufswährung	Verkaufsbetrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Netto(verlust) (in USD)
EUR	11 291 251	USD	12 193 536	15.07.2024	-82 630.21 -82 630.21

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities

Kaufwährung	Kaufbetrag	Verkaufswährung	Verkaufsbetrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) (in EUR)
CHF	49 706 409	EUR	51 110 641	15.07.2024	567 621.63
EUR	3 461 179	CHF	3 351 604	15.07.2024	-23 353.78
EUR	131 933	USD	141 543	15.07.2024	-26.69
USD	4 690 460	EUR	4 344 858	15.07.2024	28 029.90
EUR	12 264 672	AUD	20 000 000	22.08.2024	-183 101.51
EUR	85 987 708	USD	93 700 000	22.08.2024	-1 203 758.75 -814 589.20

JSS Sustainable Equity - Green Planet

Kaufwährung	Kaufbetrag	Verkaufswährung	Verkaufsbetrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) (in EUR)
CAD	97 897	CHF	64 280	12.07.2024	-83.07
CAD	106 848	USD	78 099	12.07.2024	11.85
CHF	1 144 129	CAD	1 739 495	12.07.2024	3 514.26
CHF	521 754	DKK	3 997 883	12.07.2024	6 156.62
CHF	4 305 052	EUR	4 425 802	12.07.2024	49 006.51
CHF	889 755	GBP	787 943	12.07.2024	-3 980.34
CHF	1 121 323	JPY	192 123 608	12.07.2024	49 388.39
CHF	11 787 229	USD	13 103 025	12.07.2024	34 358.46
DKK	437 408	CHF	56 296	12.07.2024	145.79
DKK	413 443	USD	59 617	12.07.2024	-140.66
EUR	446 123	CHF	430 999	12.07.2024	-1 869.46
EUR	353 622	USD	380 603	12.07.2024	-1 264.91
GBP	106 063	CHF	122 647	12.07.2024	-2 455.86
GBP	80 118	USD	102 064	12.07.2024	-726.61
JPY	21 890 619	CHF	126 916	12.07.2024	-4 749.29
JPY	18 903 455	USD	121 270	12.07.2024	-3 264.89
USD	774 193	CAD	1 059 180	12.07.2024	-110.93
USD	645 438	CHF	581 403	12.07.2024	-2 498.33
USD	358 356	DKK	2 472 260	12.07.2024	2 578.25
USD	2 799 215	EUR	2 590 489	12.07.2024	19 589.23
USD	593 805	GBP	472 969	12.07.2024	-3 849.42
USD	765 563	JPY	118 122 107	12.07.2024	27 604.58 167 360.17

JSS Bond - USD High Yield

Kaufwährung	Kaufbetrag	Verkaufswährung	Verkaufsbetrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) (in USD)
BRL	5 596 772	USD	1 076 961	15.07.2024	-71 377.74
CHF	1 544 440	USD	1 714 273	15.07.2024	8 044.76
EUR	7 802 402	USD	8 422 545	15.07.2024	-53 508.88 -116 841.86

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2024 (Fortsetzung)

9. Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

JSS Sustainable Bond - Total Return Global

Kaufwährung	Kaufbetrag	Verkaufswährung	Verkaufsbetrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) (in USD)
CHF	190 791	USD	212 663	01.07.2024	-287.29
EUR	395 928	USD	424 132	02.07.2024	269.24
EUR	3 750 000	USD	4 031 300	15.07.2024	-8 963.75
PLN	1 500 000	USD	371 830	15.07.2024	1 234.85
USD	28 522 126	EUR	25 960 000	15.07.2024	676 282.05
USD	14 175 544	PLN	56 300 000	15.07.2024	173 200.63
SGD	18 100 000	USD	13 544 356	22.07.2024	-173 089.49
USD	13 609 023	SGD	18 100 000	22.07.2024	237 475.19
AUD	10 800 000	USD	7 082 889	08.08.2024	138 066.60
USD	30 391 065	AUD	45 900 000	08.08.2024	-297 658.91
CHF	71 553 093	USD	80 983 163	06.09.2024	-660 307.15
EUR	38 465 436	USD	41 994 377	06.09.2024	-626 147.46
GBP	3 469 248	USD	4 434 704	06.09.2024	-46 913.07
USD	6 040 898	CHF	5 342 986	06.09.2024	42 686.95
USD	1 354 874	EUR	1 258 309	06.09.2024	1 601.97
USD	23 190	GBP	18 210	06.09.2024	158.25
NOK	36 000 000	USD	3 413 746	23.09.2024	-25 354.02
USD	21 540 841	NOK	231 200 000	23.09.2024	-219 690.60
USD	30 903 720	AUD	47 200 000	08.10.2024	-695 791.80
GBP	2 100 000	USD	2 640 830	15.10.2024	15 936.70
USD	13 860 549	GBP	10 900 000	15.10.2024	70 607.34
					-1 396 683.77

JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer

JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors

Kaufwährung	Kaufbetrag	Verkaufswährung	Verkaufsbetrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) (in USD)
BRL	10 122 992	USD	1 960 537	15.07.2024	-132 929.65
USD	106 364	BRL	554 581	15.07.2024	6 735.19
					-126 194.46

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency

Kaufwährung	Kaufbetrag	Verkaufswährung	Verkaufsbetrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) (in USD)
TRY	8 000 000	USD	218 430	18.09.2024	5 321.97
USD	214 961	TRY	8 000 000	18.09.2024	-9 587.13
					-4 265.16

JSS Equity - All China

Kaufwährung	Kaufbetrag	Verkaufswährung	Verkaufsbetrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) (in USD)
EUR	25 000	USD	26 760	02.07.2024	37.95
USD	597 262	HKD	4 667 164	02.07.2024	-588.17
EUR	170 220	USD	182 288	03.07.2024	183.15
HKD	2 402 223	USD	307 858	03.07.2024	-130.40
USD	12 508	EUR	11 700	03.07.2024	-33.64
					-531.11

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2024 (Fortsetzung)

9. Devisentermingeschäfte (Fortsetzung)

JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus

Kaufwährung	Kaufbetrag	Verkaufswährung	Verkaufsbetrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Netto(verlust) (in CHF)
CHF	33 849	USD	38 196	15.07.2024	-402.69
USD	1 792 920	CHF	1 610 531	15.07.2024	-2 780.69
					-3 183.38

10. Terminkontrakte

Gegenpartei: Bank J. Safra Sarasin Ltd.

Per 30.06.2024 bestanden für den JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG folgende Verpflichtungen aus offenen Terminkontrakten:

Bezeichnung	Währung	Anzahl Kontrakte	Verpflichtung USD	Nicht realisierter Gewinn/Verlust: USD
10Y TREASURY NOTES USA	USD	-50	-5 081 000.00	9 687.50
				9 687.50

Per 30.06.2024 bestanden für den JSS Sustainable Bond - Global Short-term folgende Verpflichtungen aus offenen Terminkontrakten:

Bezeichnung	Währung	Anzahl Kontrakte	Verpflichtung USD	Nicht realisierter Gewinn/Verlust: USD
5Y TREASURY NOTES USA	USD	50	5 005 000.00	4 296.85
				4 296.85

Per 30.06.2024 bestanden für den JSS Sustainable Bond - Euro Broad folgende Verpflichtungen aus offenen Terminkontrakten:

Bezeichnung	Währung	Anzahl Kontrakte	Verpflichtung EUR	Nicht realisierter Gewinn/Verlust: EUR
SHORT EURO BTP ITALIAN BOND	EUR	1	100 940.00	-30.00
EURO-BUXL-FUTURES	EUR	1	95 941.00	-3 055.16
EURO-BUXL-FUTURES	EUR	-1	-95 941.00	243.90
10Y BTP ITALIAN BOND	EUR	-21	-2 178 120.00	4 791.37
10Y BTP ITALIAN BOND	EUR	1	103 720.00	-1 327.30
EURO BUND	EUR	1	101 114.00	-447.39
EURO BUND	EUR	-101	-10 212 514.00	27 500.00
EURO BOBL	EUR	-1	-98 355.00	-530.00
EURO BOBL	EUR	51	5 016 105.00	-8 738.89
EURO SCHATZ	EUR	151	15 122 650.00	-12 243.77
EURO SCHATZ	EUR	-1	-100 150.00	-305.49
EURO OAT FUT FRENCH GVT BDS	EUR	-1	-97 610.00	401.51
EURO OAT FUT FRENCH GVT BDS	EUR	26	2 537 860.00	207.08
				6 465.86

Per 30.06.2024 bestanden für den JSS Sustainable Bond - EUR Corporates folgende Verpflichtungen aus offenen Terminkontrakten:

Bezeichnung	Währung	Anzahl Kontrakte	Verpflichtung EUR	Nicht realisierter Gewinn/Verlust: EUR
EURO BUND	EUR	41	4 145 674.00	27 004.32
EURO BOBL	EUR	30	2 950 650.00	-5 700.00
				21 304.32

Per 30.06.2024 bestanden für den JSS Sustainable Bond - Total Return Global folgende Verpflichtungen aus offenen Terminkontrakten:

Bezeichnung	Währung	Anzahl Kontrakte	Verpflichtung USD	Nicht realisierter Gewinn/Verlust: USD
EURO BOBL	EUR	93	9 803 313.33	70 596.17
LONG GILT STERLING FUTURES	GBP	95	11 977 726.73	61 245.65

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2024 (Fortsetzung)

10. Terminkontrakte (Fortsetzung)

Bezeichnung	Währung	Anzahl Kontrakte	Verpflichtung USD	Nicht realisierter Gewinn/Verlust: USD
JAPANESE GOV. BDS FUTURE 10Y	JPY	-15	-8 880 041.36	5 594.93
30Y TREASURY NOTES USA	USD	-57	-5 999 250.00	-204 937.50
10Y TREASURY NOTES USA	USD	208	21 136 960.00	259 077.16
5Y TREASURY NOTES USA	USD	260	26 026 000.00	262 031.38
				453 607.79

11. Eventualverpflichtungen aus Optionen

Gegenpartei: Bank J. Safra Sarasin Ltd.

Eventualverpflichtungen aus Optionen bestehen per 30.06.2024 wie folgt:

JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF) -18 010 843.65 EUR

JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities

Bezeichnung	Währung	Put/Call	Strike	Fälligkeit	Anzahl Kontrakte	Verpflichtung	Marktwert
EURO STOXX 50 PR	EUR	CALL	5 400.00	20.12.2024	-81	-678 974.40	-29 565.00
EURO STOXX 50 PR	EUR	PUT	4 400.00	20.12.2024	-81	682 992.00	-52 245.00
EURO STOXX 50 PR	EUR	PUT	4 850.00	20.12.2024	81	-1 594 987.20	129 195.00
SPX - S&P 500 INDICES	USD	PUT	5 100.00	20.12.2024	60	-5 596 081.18	407 781.67
SPX - S&P 500 INDICES	USD	PUT	4 450.00	20.12.2024	-60	1 569 489.15	-130 328.90
SPX - S&P 500 INDICES	USD	CALL	5 750.00	20.12.2024	-60	-12 393 282.02	-711 546.54

12. Swap-Transaktionen

Gegenpartei: Bank J. Safra Sarasin Ltd.

Zinsswaps

JSS Sustainable Bond - Euro Broad

Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn/Verlust EUR	Fälligkeit
EUR	-20 000 000.00	1 677.76	01.07.2026
EUR	10 000 000.00	-3 266.91	01.07.2026
EUR	-10 000 000.00	580.98	30.06.2026
EUR	10 000 000.00	-3 011.02	26.06.2026
EUR	30 000 000.00	-8 502.69	26.06.2026
EUR	-3 000 000.00	18 555.25	06.09.2034
EUR	-4 000 000.00	12 075.86	06.09.2030
EUR	-5 000 000.00	43 841.03	06.09.2034
EUR	4 000 000.00	-88 132.75	09.09.2054
EUR	-2 200 000.00	2 652.47	13.05.2054
EUR	5 000 000.00	-14 119.40	15.05.2034
EUR	-5 000 000.00	42 751.91	09.05.2054
EUR	10 000 000.00	-52 352.56	09.05.2034
EUR	-2 200 000.00	48 895.74	12.04.2039
EUR	3 200 000.00	-55 639.47	12.04.2034
EUR	-1 000 000.00	6 234.51	22.02.2036
EUR	-3 000 000.00	55 735.59	08.03.2039
		7 976.30	

JSS Sustainable Bond - Total Return Global

Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn/Verlust USD	Fälligkeit
EUR	-1 500 000.00	30 806.08	26.03.2054

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2024 (Fortsetzung)

12. Swap-Transaktionen (Fortsetzung)

Währung	Nennwert	Nicht realisierter Gewinn/Verlust USD	Fälligkeit
EUR	7 400 000.00	-50 550.81	26.03.2029
EUR	-2 200 000.00	20 332.39	09.03.2054
EUR	10 000 000.00	-118 480.68	07.03.2029
		-117 893.02	

13. Techniken für eine effiziente Portfolioverwaltung und Sicherheiten

Unter „effizienter Portfolioverwaltung“ werden folgende Techniken verstanden:

- Wertpapierleihe
- Pensionsgeschäfte
- Umgekehrte Pensionsgeschäfte

Die Gesellschaft wendet keine dieser Techniken an. Die Gesellschaft berücksichtigt bei der Berechnung der Grenzen für das Kontrahentenrisiko keine erhaltenen Sicherheiten. Aus diesem Grund wird auf Angaben zu zulässigen Arten von Sicherheiten, zum erforderlichen Umfang der Besicherung und zur Haircut-Strategie sowie, im Fall von Barsicherheiten, zur Strategie für das erneute Anlegen (einschließlich der damit verbundenen Risiken) verzichtet.

14. Wechselkurse zur Konsolidierung

1 EUR	=	0.963075	CHF
		1.071750	USD

15. Erhaltene Sicherheiten

Teilfonds	Währung	Betrag	Gezahlt/erhalten	Gegenpartei
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	USD	50 000.00	erhalten	Bank J. Safra Sarasin Ltd
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	EUR	320 000.00	erhalten	CACEIS Investor Services Bank S.A.
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	EUR	3 160 000.00	erhalten	Bank J. Safra Sarasin Ltd
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	USD	3 790 000.00	gezahlt	Royal Bank of Canada London
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	EUR	330 000.00	erhalten	CACEIS Investor Services Bank S.A.
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	USD	110 000.00	erhalten	Bank J. Safra Sarasin Ltd
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	EUR	490 000.00	erhalten	CACEIS Investor Services Bank S.A.
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	EUR	290 000.00	erhalten	Bank J. Safra Sarasin Ltd
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	EUR	780 000.00	erhalten	CACEIS Investor Services Bank S.A.
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	EUR	1 660 000.00	gezahlt	Bank J. Safra Sarasin Ltd
JSS Sustainable Equity - Green Planet	EUR	360 000.00	erhalten	CACEIS Investor Services Bank S.A.
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	USD	1 090 000.00	gezahlt	Bank J. Safra Sarasin Ltd

16. Transaktionsgebühr

Durch den Kauf oder Verkauf von übertragbaren Wertpapieren, Geldmarktinstrumenten, Derivaten oder sonstigen zulässigen Vermögenswerten entstehen der Gesellschaft Transaktionskosten.

Die Transaktionskosten umfassen Maklergebühren, Stempelgebühren, örtliche Steuern und fremde Gebühren, die in den Kosten der gekauften und verkauften Wertpapiere enthalten sind und die einem Teilfonds zusätzlich zu den angegebenen Transaktionskosten in Rechnung gestellt wurden. Sie sind in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Netto-Fondsvermögens ausgewiesen.

Für das Geschäftsjahr zum 30.06.2024 sind in der Gesellschaft folgende Transaktionskosten in Verbindung mit dem Kauf oder Verkauf von Anlagen in Wertpapieren und ähnlichen Transaktionen entstanden:

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG	239 734.51	USD
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets	130 273.75	USD
JSS Sustainable Equity - Global Dividend	478 049.09	USD
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)	22 803.03	EUR
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond	0.00	EUR
JSS Sustainable Equity - Global Thematic	591 126.10	EUR
JSS Sustainable Bond - Global Short-term	37 565.36	USD
JSS Sustainable Bond CHF	0.00	CHF
JSS Sustainable Bond - Euro Broad	1.59	EUR
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates	346.47	EUR
JSS Sustainable Equity - Europe	80 756.28	EUR

Erläuterungen zum Abschluss per 30.06.2024 (Fortsetzung)

16. Transaktionsgebühr (Fortsetzung)

JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035	135 308.30	EUR
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global	11 954.69	EUR
JSS Sustainable Equity - USA	302 605.99	USD
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities	428 968.76	EUR
JSS Sustainable Equity - Green Planet	208 161.63	EUR
JSS Bond - USD High Yield	3 752.78	USD
JSS Sustainable Bond - Total Return Global	37 954.91	USD
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer	160 736.36	USD
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors	502 142.19	USD
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency	14 699.82	USD
JSS Equity - All China	818 904.98	USD
JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus	100.58	CHF

Des Weiteren, im Einklang mit den handelsüblichen Marktpraktiken an Rentenmärkten, unterliegen Käufe und Verkäufe dem „Bid-Offer-Spread“ (Differenz zwischen Kauf-/Verkaufspreis und Marktwert), welcher dem Entgelt des Brokers entspricht.

17. Ereignisse während des Jahres

Mit Wirkung zum 03.07.2023 wurde der JSS Investmentfonds II – Sustainable Bond – Asia Opportunities mit dem JSS Investmentfonds – JSS Sustainable Bond – Emerging Markets Corporate IG zusammengelegt.

Mit Wirkung zum 25.10.2023 wurde der JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CHF) mit dem JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities zusammengelegt.

Mit Wirkung zum 02.11.2023 wurde der JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR) mit dem JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR) zusammengelegt.

Der JSS Investmentfonds - JSS Sustainable Equity - Swiss SME Plus wurde am 20.12.2023 aufgelegt.

Im Oktober 2022 gaben CACEIS und Royal Bank of Canada (RBC) bekannt, dass sie eine Absichtserklärung für die beabsichtigte Übernahme des europäischen Asset Servicing Geschäfts von RBC durch CACEIS unterzeichnet haben.

Im Rahmen dieser Übernahme würde CACEIS das gesamte ausgegebene Anteilskapital von RBC Investor Services Bank S.A. (IS Bank) erwerben.

Der Verkauf der IS Bank erfolgte nach der Genehmigung durch die Aufsichtsbehörden am 03.07.2023, und RBC Investor Services Bank S.A. wurde zu CACEIS Investor Services Bank S.A.

Mit Wirkung zum 01.06.2024 firmierte CACEIS Investor Services Bank S.A. in CACEIS Bank, Luxembourg Branch um.

Am 24.02.2022 marschierten die russischen Truppen in die Ukraine ein. Als Reaktion darauf haben mehrere Länder, darunter die Europäische Union, die Schweiz, das Vereinigte Königreich, die Vereinigten Staaten von Amerika, Kanada, Japan und Australien, mehrschichtige Wirtschaftssanktionen gegen Russland verhängt. Darüber kam es zu einer Aussetzung der Notierung einer Reihe börsennotierter russischer Unternehmen an bestimmten Börsen und/oder zu deren Ausschluss aus Marktindizes.

Nach der jüngsten Entwicklung des Ukraine Konflikts und den Bewertungen durch den Bewertungsausschuss der Verwaltungsgesellschaft und des Verwaltungsrats des Fonds wies die Verwaltungsgesellschaft den Fondsverwalter an, die folgenden sanktionierten Vermögenswerte mit Null zu bewerten. Diese Anweisung ist mit dem NIW vom 8. April in Kraft getreten.

JSS Sustainable Bond - Global Short-term

XS0935311240 - SB CAPITAL 5.25% 13-23.05.23

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG

XS0842078536 - VTB CAP 6.95% 12-17.10.22

XS2063279959 - ALFA BK 5.95% 19-15.04.30

XS0935311240 - SB CAPITAL 5.25% 13-23.05.23

Auch die auf RUB lautenden Vermögenswerte im JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency werden seit der Entscheidung des Verwaltungsrats am 25.10.2023 mit einem Wert von Null ausgewiesen.

RU000A0JTK38 - MIN FIN RUF 7.05% 19.1.28

RU000A100EF5 - MIN FIN RUF 7.70% 16.3.39

RU000A0ZYUA9 - MIN FIN RUF 6.9% 23.05.29

RU000A0JS3W6 - RUSSIA 8.15% 3.2.27 S 26207

RU000A0JXQF2 - RUSSIA 7.1% 17-16.10.24

18. Ereignisse nach dem Stichtag

Es gab keine wesentlichen Ereignisse nach dem Bilanzstichtag zu melden.

Sonstige ungeprüfte Informationen

Risikomanagementverfahren

Die Verwaltungsgesellschaft verwendet für die Gesellschaft und jeden Teilfonds ein Risikomanagementverfahren im Einklang mit dem Gesetz von 2010 und sonstigen anwendbaren Vorschriften, insbesondere dem Rundschreiben 11/512 der CSSF (Commission de Surveillance du Secteur Financier).

Risikomessmethode - Commitment-Ansatz

Im Rahmen des Risikomanagementverfahrens wird das Gesamtrisiko folgender Teilfondsvermögen durch den Commitment-Ansatz gemessen und kontrolliert:

JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Corporate IG
JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets
JSS Sustainable Equity - Global Dividend
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (CH)
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Balanced (EUR)
JSS Sustainable Multi Asset - Thematic Growth (EUR)
JSS Twelve Sustainable Insurance Bond
JSS Sustainable Equity - Global Thematic
JSS Sustainable Bond - Global Short-term
JSS Sustainable Bond CHF
JSS Sustainable Bond - Euro Broad
JSS Sustainable Bond - EUR Corporates
JSS Sustainable Equity - Europe
JSS Sustainable Equity - Global Climate 2035
JSS Sustainable Equity - Real Estate Global
JSS Sustainable Equity - USA
JSS Sustainable Multi Asset - Global Opportunities
JSS Sustainable Equity - Green Planet
JSS Bond - USD High Yield
JSS Sustainable Bond - Total Return Global
JSS Sustainable Equity - Next-Gen Consumer
JSS Sustainable Equity - Tech Disruptors
JSS Sustainable Bond - Emerging Markets Local Currency
JSS Equity - All China
SS Sustainable Equity - Swiss SME Plus

Risikomessmethode - Value-at-Risk / (VaR)-Ansatz

JSS Bond - Emerging Markets Local Currency: absoluter VaR-Ansatz. Folgende Werte wurden für das Geschäftsjahr gemessen (ungeprüft):

Minimum VaR:	3.99%
Durchschnittlicher VaR:	5.39%
Maximum VaR:	7.74%
Mindest-Hebelwirkung:	0.00%
Durchschn. Hebelwirkung:	14.32%
Maximale Hebelwirkung:	48.93%

Die Berechnung des Value-at-Risk erfolgt aufgrund folgender Standards:

Monte-Carlo-Simulation;
einseitiges Konfidenzintervall von 99%;
Halteperiode, die einem Monat entspricht (20 Tage);
effektiver Betrachtungszeitraum (historisch) der Risikofaktoren von einem Jahr (250 Tage);
tägliche Aktualisierung der Daten, wöchentliche Berechnung der Korrelationsmatrix;
(unter RiskMetrics, was per 2. Januar 2019 implementiert wurde, erfolgt die Aktualisierung der vorgenannten Matrix täglich);
tägliche Berechnung entsprechend der NIW-Frequenz.

Die Berechnung der Hebelwirkung erfolgt aufgrund der Summe der Kontraktgrößen.

Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte Verordnung (EU 2015/2365)

Im Geschäftsjahr, auf das sich dieser Bericht bezieht, hat sich die Gesellschaft nicht an Geschäften beteiligt, die der Verordnung (EU) 2015/2365 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung unterliegen. Dementsprechend sind keine Gesamt-, Konzentrations- oder Transaktionsdaten oder Angaben zur Weiterverwendung oder zur Verwahrung von Sicherheiten zu berichten.

Sonstige ungeprüfte Informationen (Fortsetzung)

Erklärung zur Vergütungspolitik

Als Verwaltungsgesellschaft des Fonds hat die J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A. eine Vergütungspolitik eingeführt, die den Anforderungen des geänderten Gesetzes vom 17.12.2010 betreffend Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner geänderten Fassung entspricht. Das Vergütungssystem ist so ausgelegt, dass es in Einklang mit einem soliden und effektiven Risikomanagement steht, sodass es weder zum Eingehen von Risiken ermutigt, die nicht den Risikoprofilen, den vertraglichen Bestimmungen oder den Satzungen der verwalteten Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) entsprechen, noch verhindert, dass die J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A. im besten Interesse der OGAW handelt.

Die Vergütungspolitik steht in Einklang mit der Geschäftsstrategie sowie den Zielen, Werten und Interessen der J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A. und der Anleger der von ihr verwalteten OGAW und beinhaltet ferner Maßnahmen zur Vermeidung von Interessenkonflikten.

Außertarifliche Mitarbeiter unterliegen der Vergütungspolitik für außertarifliche Mitarbeiter der J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A. Die Vergütung von außertariflichen Mitarbeitern setzt sich aus einem angemessenen jährlichen Fixbetrag und einem variablen leistungs-/ergebnisabhängigen Betrag zusammen. Die Gesamtvergütung außertariflicher Mitarbeiter basiert auf nachhaltigen, quantitativen und qualitativen Kriterien der Leistungsbeurteilung, die so objektiv wie möglich sind, unter Berücksichtigung der inhärenten Risiken und abgestuft nach Verantwortung und bekleideter Position. Je höher der Anteil der variablen Vergütung an der Gesamtvergütung ist, desto größer ist der Einfluss auf das operative Geschäft und die Risikotrends. Die quantitativen und qualitativen Kriterien der Leistungsbeurteilung werden auf die verschiedenen Aufgaben der Mitarbeiter und die verschiedenen Situationen, die im jeweiligen Leistungsbeurteilungszeitraum vorliegen, abgestimmt.

Identifizierte Mitarbeiter unterliegen der Vergütungspolitik für identifizierte Mitarbeiter der J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A. Die Vergütung von identifizierten Mitarbeitern setzt sich aus einem angemessenen jährlichen Fixbetrag und einem variablen leistungs-/ergebnisabhängigen Betrag zusammen. Die Gesamtvergütung identifizierter Mitarbeiter basiert auf nachhaltigen, quantitativen und qualitativen Kriterien der Leistungsbeurteilung, die so objektiv wie möglich sind, unter Berücksichtigung der inhärenten Risiken und abgestuft nach Verantwortung und bekleideter Position. Je höher der Anteil der variablen Vergütung an der Gesamtvergütung ist, desto größer ist der Einfluss auf das operative Geschäft und die Risikotrends. Die quantitativen und qualitativen Kriterien der Leistungsbeurteilung werden auf die verschiedenen Aufgaben der Mitarbeiter und die verschiedenen Situationen, die im jeweiligen Leistungsbeurteilungszeitraum vorliegen, abgestimmt.

Die Gesamtvergütung für das Jahr zum 31.12.2023 für die Mitarbeiter der J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A. in Bezug auf die OGAW beläuft sich auf 1 793 865 EUR.

Dieser Betrag setzt sich wie folgt zusammen:

Fixe Vergütung:	EUR 1 591 119
Variable Vergütung:	EUR 202 746
Anzahl der Mitarbeiter:	11

Die genannten Zahlen repräsentieren den Teil der Vergütung, den J. Safra Sarasin Fund Management (Luxembourg) S.A. nach Aufwand für die OGAW gewichtet an seine Mitarbeiter zahlt.

Nähere Einzelheiten zur Vergütungspolitik können kostenlos von der Website www.jsafrasarasin.com heruntergeladen werden.

Der Compliance-Officer prüft jährlich, ob die Vergütungspolitik ordnungsgemäß umgesetzt wurde. Für das Geschäftsjahr zum 31.12.2023 wurden keine Unregelmäßigkeiten festgestellt.

Es gab im Geschäftsjahr zum 31.12.2023 keine wesentlichen Änderungen der Vergütungspolitik.

Steuerhinweis für JSS Sustainable Equity - Systematic Emerging Markets

Dieser Teilfonds ist aus steuerlicher Sicht für in Deutschland ansässige Anleger nicht geeignet.

Informationen für Anleger in der Schweiz

Der Vertreter in der Schweiz ist J. Safra Sarasin Investmentfonds AG, Wallstrasse 9, CH-4002 Basel. Die Zahlstelle in der Schweiz ist Bank J. Safra Sarasin Ltd, Elisabethenstrasse 62, CH-4002 Basel. Der Prospekt und die KIIDs, die Satzung sowie die Jahres- und Halbjahresberichte sind kostenlos beim Vertreter und bei allen Vertriebsstellen erhältlich und auch auf der Website www.jsafrasarasin.ch/funds verfügbar.

Zusätzliche Informationen für Anleger in der Bundesrepublik Deutschland.

Die Gesellschaft hat die Absicht, Investmentanteile zu vertreiben, der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht (BaFin) in Bonn angezeigt und ist seit Abschluss des Anzeigeverfahrens zum Vertrieb berechtigt.

Vertriebs- und Informationsstelle in Deutschland

J. Safra Sarasin (Deutschland) GmbH
Tausanstraße 17
D-60325 Frankfurt am Main

hat in Deutschland die Funktion der Vertriebs- und Informationsstelle (die „deutsche Vertriebs- und Informationsstelle“) übernommen.

Die deutsche Vertriebs- und Informationsstelle führt ein Zahlstellenkonto, auf das Anleger Einzahlungen in Euro per Überweisung, Scheck oder im Rahmen der gesetzlichen Vorschriften in bar leisten können. Die deutsche Vertriebs- und Informationsstelle sendet die Anlagebeträge nach Gutschrift auf dem Zahlstellenkonto umgehend mittels SWIFT auf das Konto der Verwahrstelle des JSS Investmentfonds unter Angabe des entsprechenden Teilfonds.

Sonstige ungeprüfte Informationen (Fortsetzung)

Vertriebs- und Informationsstelle in Deutschland (Fortsetzung)

Rücknahme- und Umtauschanträge für die Aktien können bei der deutschen Vertriebs- und Informationsstelle zur Weiterleitung an die Gesellschaft eingereicht werden. Aktionäre können verlangen, dass alle Zahlungen (Erlöse aus Rücknahmen, Ausschüttungen und sonstige Zahlungen) über die deutsche Vertriebs- und Informationsstelle geleistet werden.

Vertriebs- und Informationsstelle in Deutschland

Bei der deutschen Vertriebs- und Informationsstelle sind der Verkaufsprospekt und die wesentlichen Anlegerinformationen (KIIDs), die Satzung der Gesellschaft, der Jahresbericht der Gesellschaft einschließlich des geprüften Abschlusses und der ungeprüfte Halbjahresbericht kostenlos als Druckstücke sowie etwaige Mitteilungen an die Anleger und die Ausgabe-, Rücknahme- und Umtauschpreise, Zwischengewinne und ausschüttungsgleichen Erträge der Aktien erhältlich.

Eine Liste der Veränderungen im Portfolio ist außerdem bei der Vertriebs- und Informationsstelle in Deutschland kostenfrei erhältlich.

Darüber hinaus können während der üblichen Geschäftszeiten bei der deutschen Vertriebs- und Informationsstelle das Management Company Agreement, das Depositary and Paying Agency Agreement sowie das Investment Fund Service Agreement eingesehen werden.

Aktienpreis- und sonstige Veröffentlichungen

Die Ausgabe-, Rücknahme- und Umtauschpreise für alle Teilfonds werden auf www.jsafrasarasin.ch/funds veröffentlicht. Etwaige Mitteilungen an die Anleger erfolgen in der Bundesrepublik Deutschland auf www.jsafrasarasin.ch/funds.

Name des Produkts: JSS Investmentfonds SICAV – JSS Sustainable Bond – Emerging Markets Corporate IG
 Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300KODVGM5FYQ564

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja		<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Nein	
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 37,70% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt integriert umweltbezogene, soziale und die Unternehmensführung betreffende Aspekte („ESG“) in den Investitionsprozess mit dem Ziel, ein überdurchschnittlich gutes ESG-Profil für das gesamte Portfolio gemäß der von J. Safra Sarasin („JSS“) entwickelten Nachhaltigkeitsmatrix zu erreichen.

Das ESG-Rating von JSS bewertet die Emittenten im Verhältnis zu ihrer Vergleichsgruppe und reicht von A für Emittenten, die in die Spitzenklasse eingestuft werden, bis zu D für Emittenten, die ggf. eine umstrittene Geschäftstätigkeit ausüben. Beim nachhaltigen Investieren werden Emittenten, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und bei denen die Wahrscheinlichkeit für erhebliche Beeinträchtigungen daher erhöht ist, mit C (schlechteste Leistung im Branchenvergleich) oder D (wegen umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse von Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, die Kreditratings von Staaten unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien zu analysieren. JSS misst die nachhaltige Wirtschaftsleistung eines Landes nach (i) der Verfügbarkeit von natürlichen Ressourcen und (ii) danach, wie effizient diese eingesetzt werden. Die Nachhaltigkeitsbewertungen von Ländern stellen ein ergänzendes Instrument der finanziellen Analyse ihrer Kreditratings dar.

Folgende Ausschlusskriterien (mit Umsatzschwellen) wurden im Berichtszeitraum auf das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Waffenarten, die angesichts ihrer langfristigen humanitären Folgen und/oder der großen Anzahl ziviler Opfer bei ihrem Einsatz als umstritten

eingestuft werden. Dazu zählen u. a. biologische, chemische und atomare Waffen, Streumunition und Anti-Personenminen (Umsatzschwelle: 0%);

- Verteidigung und Rüstung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und wesentliche Bauteile) sowie Hilfssysteme und Dienstleistungen im Zusammenhang mit Waffen (Waffeneinsatzsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5%);

- Kohle: Unternehmen, die in erheblichem Umfang im Kohlegeschäft tätig sind und zugleich keine solide Strategie für den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft vorweisen können (Umsatzschwelle: 5% für den Kohlebergbau, 10% für die Kohleverstromung sowie 10% für die Summe aus beiden Komponenten);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen zwecks landwirtschaftlicher Nutzung gentechnisch verändern (Umsatzschwelle: 0%);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0%);

- Tabak: Hersteller von Tabakprodukten (Umsatzschwelle: 5%);

- Erwachsenenunterhaltung: Produzenten von Erwachsenenunterhaltung (Umsatzschwelle: 5%);

- Verstöße gegen Menschenrechte und sonstige Prinzipien des Global Compact: Unternehmen, die nach Maßgabe anerkannter internationaler Standards an schweren Verstößen gegen Menschenrechte oder sonstige Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen beteiligt sind (Umsatzschwelle: 0%).

- Palmöl: Unternehmen mit einem Bezug zu Palmöl ohne ausreichende Zertifizierung durch den Roundtable on Sustainable Palm Oil („RSPO“) werden ausgeschlossen (Umsatzschwelle: 5% für Palmölproduzenten, wenn weniger als 75% der Standorte eine RSPO-Zertifizierung besitzen).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Zeitpunkt dar. Bei nachhaltigen Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem sozialen Ziel beitragen, wird davon ausgegangen, dass sie zu beiden gleichermaßen beitragen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● *Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?*

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	44
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	47

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators (J-1)
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	44	41
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	47	46

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der CO₂-Emissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren Zielen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) in Einklang stehen, oder durch die Einnahme einer Spitzenposition im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren innerhalb der Vergleichsgruppe.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Prüfung auf erhebliche Beeinträchtigungen (Do no significant harm, „DSNH“) schließt Emittenten aus, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellenwerte der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen nicht erreichen. Ein Emittent besteht die Prüfung, wenn er nach der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Bewertung A oder B erhält. Wenn der Emittent im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist, muss er außerdem über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügen, um die Prüfung zu bestehen. Zu den Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen gehören Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie Kraftwerks- und Koks Kohle.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen nach Maßgabe der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen im Rahmen des Investitionsprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten negativen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Investitionen erreicht, die die ökologischen oder sozialen Mindestschwellenwerte nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Mitwirkungsmaßnahmen dienen der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Die Definition des ESG-Auswahlverfahrens und Anlageuniversums beruht auf den

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Richtlinien und der Strategie von JSS für nachhaltiges Investieren, in denen die Prinzipien mehrerer internationaler Übereinkommen und Normen enthalten sind, u. a.:

Die Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen,

Die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

Der Global Compact der Vereinten Nationen,

Die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

Die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

Die Grundsätze zu Kinderrechten und unternehmerischem Handeln,

Die Arbeitsstandards der ILO,

Die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

Das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

Das Übereinkommen über Streumunition.

Der ESG-Auswahlprozess trägt dazu bei, börsennotierte Unternehmen zu ermitteln, die vermeintlich gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung verstoßen, wie in den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte vorgesehen. Diese Unternehmen werden als unvereinbar mit den o. a. Prinzipien erachtet und aus dem Universum nachhaltiger Investitionen von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Unternehmen

THG-Emissionen, CO₂-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind, Anteil des Verbrauchs und der Erzeugung von nicht erneuerbaren Energien, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (berücksichtigt für Ausschlüsse, Klimaversprechen und innerhalb der Nachhaltigkeitsmatrix)

Die schädlichsten Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe werden ausgeschlossen. Seit dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Umsätze aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 10\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 10\%$ aus einer Kombination aus dem Kraftwerkskohlebergbau und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

In Sektoren, in denen CO₂-Emissionen einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine CO₂-Emissionen. Dies umfasst eine Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Senkung der Emissionsintensität seines Kerngeschäfts, zur Senkung seines künftigen Energieverbrauchs oder seiner Treibhausgasemissionen (Scope 1, 2 und 3).

In Sektoren, in denen Möglichkeiten im Bereich der erneuerbaren Energien einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf erneuerbare Energien. Hierzu zählt auch die Bewertung der Kapazität eines Unternehmens im Bereich der erneuerbaren Energien.

Im Mai 2020 hat JSS ein Klimaversprechen abgegeben, das auf Klimaneutralität bis zum Jahr 2035 abzielt. Bei Fonds, bei denen dieses Versprechen bereits umgesetzt wurde, werden Treibhausgasemissionen anhand des CO₂-Fußabdrucks überwacht; diese Kontrollen werden für eine Teilmenge der Fonds durchgeführt. Die Einhaltung des Klimaversprechens wird mithilfe rückwärtsgerichteter Dekarbonisierungspfade überprüft, mit denen Übergangsrisiken gemindert werden sollen. Die meisten Fonds, die das Klimaversprechen umgesetzt haben, wenden folgende Methode an: Das ursprüngliche Ziel entspricht einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen des Referenzwerts um 30%. Diese Zielvorgabe wird in den folgenden Jahren um 7% verringert. Ab 2030 wird das Ziel linear gesenkt, bis das Netto-Null-Ziel im Jahr 2035 schließlich erreicht wird. Die THG-Emissionen des Portfolios auf der Grundlage der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro Mio. USD des Unternehmenswertes (EVIC) ausgedrückt.

Tätigkeiten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung wesentliche ESG-Faktoren darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf Biodiversität und Landnutzung. Hierzu zählt auch eine Bewertung der Auswirkungen der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens auf die Biodiversität. Zudem wird Palmöl konsequent ausgeschlossen.

Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Emissionen in Wasser (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Emissionen in Wasser erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Wasserbewirtschaftung. Die Wasserbewirtschaftung umfasst eine Bewertung wassereffizienter Produktionsprozesse, Trends bei der Wasserintensität sowie messbare, zeitlich befristete Zielvorgaben zur Senkung des Wasserverbrauchs. Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Gefährlicher Abfall (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Schadstoffemissionen und schädlichen Abfällen erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Schadstoffemissionen und seine Abfallwirtschaft. Der Umgang mit Schadstoffemissionen umfasst eine Bewertung der Bemühungen zur Kontrolle und Verringerung der Menge giftiger und krebserregender Nebenprodukte im Rahmen der Geschäftstätigkeit, Trends bei der Schadstofffreisetzung sowie messbare, zeitlich begrenzte Zielvorgaben zur Reduzierung von Schadstoffemissionen.

Verstöße gegen UNGC-Grundsätze (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Fehlende Prozesse zur Überwachung der Einhaltung des UNGC

Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Bestandteil der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Investitionsprozess einbeziehen, sobald die Offenlegungsquoten ausreichend

sind. In der Zwischenzeit erfolgt eine ESG-Überwachung, bei der unter anderem regelmäßige Screenings auf Verstöße gegen die UNGC-Vorgaben durchgeführt werden. JSS strebt eine Berücksichtigung dieses Indikators an, sobald sich die Datenzuverlässigkeit und -verfügbarkeit verbessern.

Engagement in umstrittenen Waffen (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS wird seiner Verantwortung in Bezug auf umstrittene Waffen aktiv gerecht, indem es sie konzernweit ausschließt. JSS investiert keine Eigenmittel in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich der umstrittenen Waffen tätig sind. Ferner übernimmt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für solche Unternehmen bzw. keine Dienstleistungen im Zusammenhang mit Kapitalmärkten oder Fusionen und Übernahmen.

Staaten

THG-Emissionsintensität (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die externen Umweltkosten eines Landes. Bewertet werden unter anderem die Treibhausgasemissionen pro Kopf.

Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Landes in Bezug auf Grundrechte.



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 – 30.06.2024

Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
SCHATZWECHSEL	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	2,86	US
SANDS CHINA LTD	Kunst, Unterhaltung und Erholung	1,44	KY
PRUDENTIAL FUNDING ASIA	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,29	GB
SANDS CHINA LTD	Kunst, Unterhaltung und Erholung	1,23	KY
STANDARD CHARTERED PLC	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,16	GB
ANTOFAGASTA PLC	Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	1,13	GB
CK HUTCHISON INTL 24	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,10	KY
PROSUS NV	Information und Kommunikation	1,10	NL
RELIANCE INDUSTRIES LTD	Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,09	IN
UAE INT'L GOVT BOND	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	1,08	AE
BANGKOK BANK PCL/HK	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,05	TH
GOHL CAPITAL LTD	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,02	IM
DP WORLD LTD UAE	Verkehr und Lagerei	1,01	AE
HUNT OIL CO OF PERU	Energieversorgung	1,00	PE
SOCIEDAD QUIMICA Y MINER	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,95	CL

Hauptinvestitionen per 30.06.2024 (Ende des Geschäftsjahres). Keine bedeutenden Abweichungen über das Geschäftsjahr.

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Die Gewichtung von Anleihen wird ermittelt, indem der Marktpreis der Anleihe (einschließlich aufgelaufener Zinsen) durch das Gesamtvermögen des Teilfonds geteilt wird.



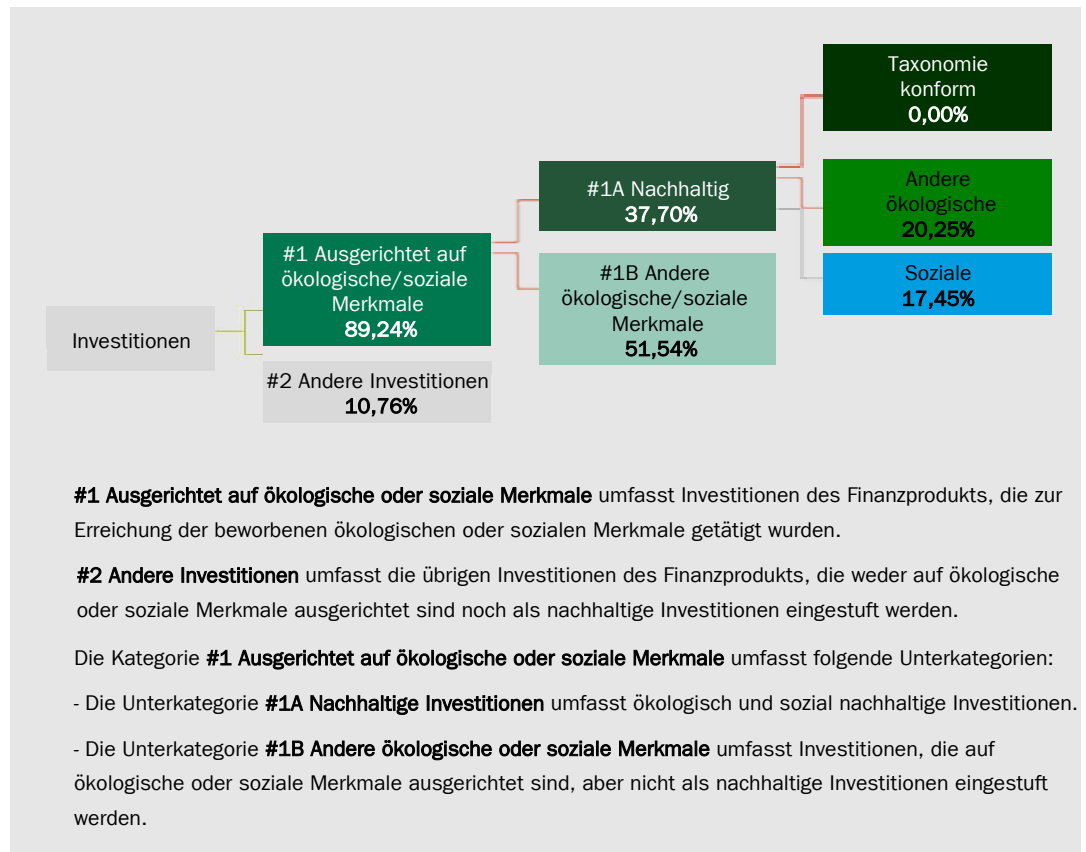
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 37,7%.

20,25% der Investitionen des Finanzprodukts waren ökologisch nachhaltige Investitionen, und 17,45% der Investitionen des Finanzprodukts waren sozial nachhaltige Investitionen. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Bezeichnung des Sektors	Anteil der Investitionen
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Sonstige Kreditinstitute (ohne Spezialkreditinstitute)	17,18%
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung – Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	9,28%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Beteiligungsgesellschaften	8,06%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Zentralbanken	7,64%
Energieversorgung – Elektrizitäts-, Gas-, Wärme- und Kälteversorgung	4,71%
Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen – Einzelhandel (ohne Handel mit Kraftfahrzeugen)	3,51%
Kunst, Unterhaltung und Erholung – Erbringung von Dienstleistungen des Sports, der Unterhaltung und der Erholung	3,32%
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung – Allgemeine öffentliche Verwaltung	3,27%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Lebensversicherungen	2,78%
Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden – Gewinnung von Erdöl und Erdgas	2,43%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,37%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von chemischen Erzeugnissen	2,14%
Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	2,07%
Information und Kommunikation – Webportale	1,96%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Fondsmanagement	1,93%
Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen – Erbringung sonstiger wirtschaftlicher Dienstleistungen für Unternehmen und Privatpersonen a. n. g.	1,80%
Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden – Erzbau	1,68%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Sonstige Finanzdienstleistungen außer Versicherungen und Pensionskassen (nicht anderweitig erfasst)	1,55%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Kokerei und Mineralölverarbeitung	1,31%
Andere	21,02%

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** enthalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend; dieses Finanzprodukt hat sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel verpflichtet, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert(1)?**

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

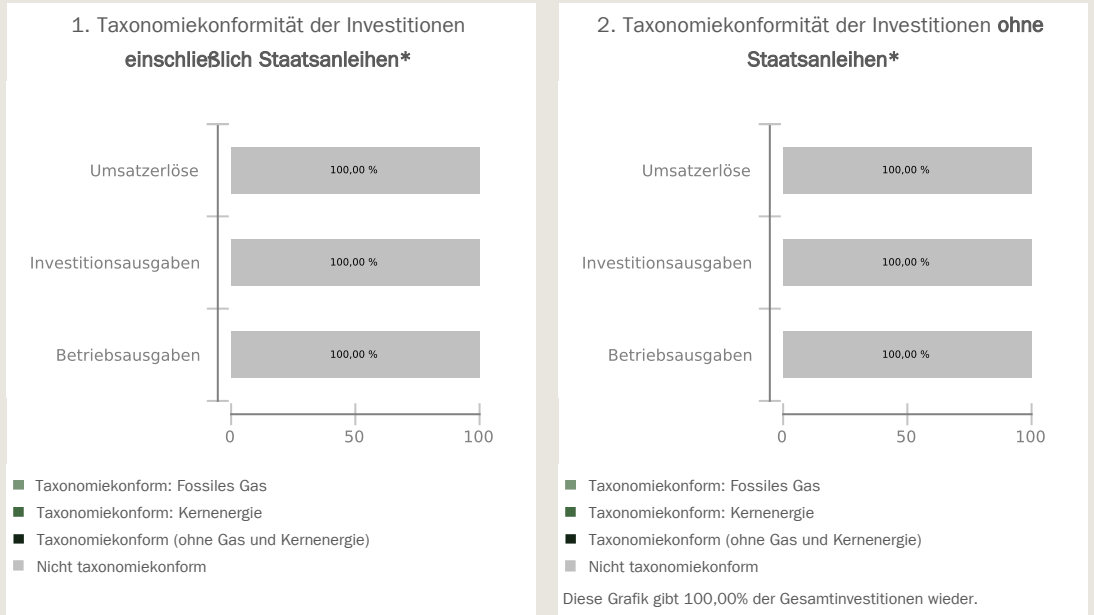
Nein

(1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind: 0,00%

Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind: 0,00%

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen	Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen (J-1)
0,00%	0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden: 20,25%

Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein; allerdings ist der Anlageverwalter gegenwärtig nicht in der Lage, den Anteil der zugrundeliegenden Investitionen des Finanzprodukts, berechnet gemäß der EU-Taxonomie, genau anzugeben. Diese Position wird jedoch weiterhin geprüft, während die zugrundeliegenden Regelungen im Laufe der Zeit fertiggestellt und mehr zuverlässige Daten verfügbar werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen: 17,45%



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts folgte einem rigorosen Verfahren, bei dem durchgängig ESG-Aspekte berücksichtigt wurden. Der Anlageverwalter wendete bei seiner Strategie die folgenden verbindlichen Kriterien an:

(a) Ausschluss von Anlagen in umstrittenen Geschäftsaktivitäten gemäß den Ausschlussrichtlinien von JSS;

(b) Erreichung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte nicht in mit C oder D bewertete Emittenten.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Name des Produkts: JSS Investmentfonds SICAV – JSS Sustainable Equity – Systematic Emerging Markets
 Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300J3PHJIR55QQ170

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 40,75% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt integriert umweltbezogene, soziale und die Unternehmensführung betreffende Aspekte („ESG“) in den Investitionsprozess mit dem Ziel, ein überdurchschnittlich gutes ESG-Profil für das gesamte Portfolio gemäß der von J. Safra Sarasin („JSS“) entwickelten Nachhaltigkeitsmatrix zu erreichen.

Das ESG-Rating von JSS bewertet die Emittenten im Verhältnis zu ihrer Vergleichsgruppe und reicht von A für Emittenten, die in die Spitzenklasse eingestuft werden, bis zu D für Emittenten, die ggf. eine umstrittene Geschäftstätigkeit ausüben. Beim nachhaltigen Investieren werden Emittenten, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und bei denen die Wahrscheinlichkeit für erhebliche Beeinträchtigungen daher erhöht ist, mit C (schlechteste Leistung im Branchenvergleich) oder D (wegen umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse von Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, die Kreditratings von Staaten unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien zu analysieren. JSS misst die nachhaltige Wirtschaftsleistung eines Landes nach (i) der Verfügbarkeit von natürlichen Ressourcen und (ii) danach, wie effizient diese eingesetzt werden. Die Nachhaltigkeitsbewertungen von Ländern stellen ein ergänzendes Instrument der finanziellen Analyse ihrer Kreditratings dar.

Folgende Ausschlusskriterien (mit Umsatzschwellen) wurden im Berichtszeitraum auf das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Waffenarten, die angesichts ihrer langfristigen humanitären Folgen und/oder der großen Anzahl ziviler Opfer bei ihrem Einsatz als umstritten

eingestuft werden. Dazu zählen u. a. biologische, chemische und atomare Waffen, Streumunition und Anti-Personenminen (Umsatzschwelle: 0%);

- Verteidigung und Rüstung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und wesentliche Bauteile) sowie Hilfssysteme und Dienstleistungen im Zusammenhang mit Waffen (Waffeneinsatzsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5%);

- Kohle: Unternehmen, die in erheblichem Umfang im Kohlegeschäft tätig sind und zugleich keine solide Strategie für den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft vorweisen können (Umsatzschwelle: 5% für den Kohlebergbau, 10% für die Kohleverstromung sowie 10% für die Summe aus beiden Komponenten);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen zwecks landwirtschaftlicher Nutzung gentechnisch verändern (Umsatzschwelle: 0%);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0%);

- Tabak: Hersteller von Tabakprodukten (Umsatzschwelle: 5%);

- Erwachsenenunterhaltung: Produzenten von Erwachsenenunterhaltung (Umsatzschwelle: 5%);

- Verstöße gegen Menschenrechte und sonstige Prinzipien des Global Compact: Unternehmen, die nach Maßgabe anerkannter internationaler Standards an schweren Verstößen gegen Menschenrechte oder sonstige Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen beteiligt sind (Umsatzschwelle: 0%).

- Palmöl: Unternehmen mit einem Bezug zu Palmöl ohne ausreichende Zertifizierung durch den Roundtable on Sustainable Palm Oil („RSPO“) werden ausgeschlossen (Umsatzschwelle: 5% für Palmölproduzenten, wenn weniger als 75% der Standorte eine RSPO-Zertifizierung besitzen).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Zeitpunkt dar. Bei nachhaltigen Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem sozialen Ziel beitragen, wird davon ausgegangen, dass sie zu beiden gleichermaßen beitragen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● *Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?*

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	100
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	0

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators (J-1)
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	100	100
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	0	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der CO₂-Emissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren Zielen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) in Einklang stehen, oder durch die Einnahme einer Spitzenposition im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren innerhalb der Vergleichsgruppe.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Prüfung auf erhebliche Beeinträchtigungen (Do no significant harm, „DSNH“) schließt Emittenten aus, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellenwerte der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen nicht erreichen. Ein Emittent besteht die Prüfung, wenn er nach der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Bewertung A oder B erhält. Wenn der Emittent im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist, muss er außerdem über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügen, um die Prüfung zu bestehen. Zu den Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen gehören Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie Kraftwerks- und Koks Kohle.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen nach Maßgabe der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen im Rahmen des Investitionsprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten negativen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Investitionen erreicht, die die ökologischen oder sozialen Mindestschwellenwerte nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Mitwirkungsmaßnahmen dienen der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Die Definition des ESG-Auswahlverfahrens und Anlageuniversums beruht auf den

Richtlinien und der Strategie von JSS für nachhaltiges Investieren, in denen die Prinzipien mehrerer internationaler Übereinkommen und Normen enthalten sind, u. a.:

Die Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen,

Die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

Der Global Compact der Vereinten Nationen,

Die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

Die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

Die Grundsätze zu Kinderrechten und unternehmerischem Handeln,

Die Arbeitsstandards der ILO,

Die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

Das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

Das Übereinkommen über Streumunition.

Der ESG-Auswahlprozess trägt dazu bei, börsennotierte Unternehmen zu ermitteln, die vermeintlich gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung verstoßen, wie in den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte vorgesehen. Diese Unternehmen werden als unvereinbar mit den o. a. Prinzipien erachtet und aus dem Universum nachhaltiger Investitionen von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Unternehmen

THG-Emissionen, CO₂-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind, Anteil des Verbrauchs und der Erzeugung von nicht erneuerbaren Energien, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (berücksichtigt für Ausschlüsse, Klimaversprechen und innerhalb der Nachhaltigkeitsmatrix)

Die schädlichsten Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe werden ausgeschlossen. Seit dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Umsätze aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 10\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 10\%$ aus einer Kombination aus dem Kraftwerkskohlebergbau und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

In Sektoren, in denen CO₂-Emissionen einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine CO₂-Emissionen. Dies umfasst eine Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Senkung der Emissionsintensität seines Kerngeschäfts, zur Senkung seines künftigen Energieverbrauchs oder seiner Treibhausgasemissionen (Scope 1, 2 und 3).

In Sektoren, in denen Möglichkeiten im Bereich der erneuerbaren Energien einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf erneuerbare Energien. Hierzu zählt auch die Bewertung der Kapazität eines Unternehmens im Bereich der erneuerbaren Energien.

Im Mai 2020 hat JSS ein Klimaversprechen abgegeben, das auf Klimaneutralität bis zum Jahr 2035 abzielt. Bei Fonds, bei denen dieses Versprechen bereits umgesetzt wurde, werden Treibhausgasemissionen anhand des CO₂-Fußabdrucks überwacht; diese Kontrollen werden für eine Teilmenge der Fonds durchgeführt. Die Einhaltung des Klimaversprechens wird mithilfe rückwärtsgerichteter Dekarbonisierungspfade überprüft, mit denen Übergangsrisiken gemindert werden sollen. Die meisten Fonds, die das Klimaversprechen umgesetzt haben, wenden folgende Methode an: Das ursprüngliche Ziel entspricht einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen des Referenzwerts um 30%. Diese Zielvorgabe wird in den folgenden Jahren um 7% verringert. Ab 2030 wird das Ziel linear gesenkt, bis das Netto-Null-Ziel im Jahr 2035 schließlich erreicht wird. Die THG-Emissionen des Portfolios auf der Grundlage der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro Mio. USD des Unternehmenswertes (EVIC) ausgedrückt.

Tätigkeiten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung wesentliche ESG-Faktoren darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf Biodiversität und Landnutzung. Hierzu zählt auch eine Bewertung der Auswirkungen der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens auf die Biodiversität. Zudem wird Palmöl konsequent ausgeschlossen.

Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Emissionen in Wasser (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Emissionen in Wasser erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Wasserbewirtschaftung. Die Wasserbewirtschaftung umfasst eine Bewertung wassereffizienter Produktionsprozesse, Trends bei der Wasserintensität sowie messbare, zeitlich befristete Zielvorgaben zur Senkung des Wasserverbrauchs. Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Gefährlicher Abfall (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Schadstoffemissionen und schädlichen Abfällen erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Schadstoffemissionen und seine Abfallwirtschaft. Der Umgang mit Schadstoffemissionen umfasst eine Bewertung der Bemühungen zur Kontrolle und Verringerung der Menge giftiger und krebserregender Nebenprodukte im Rahmen der Geschäftstätigkeit, Trends bei der Schadstofffreisetzung sowie messbare, zeitlich begrenzte Zielvorgaben zur Reduzierung von Schadstoffemissionen.

Verstöße gegen UNGC-Grundsätze (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Fehlende Prozesse zur Überwachung der Einhaltung des UNGC

Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Bestandteil der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Investitionsprozess einbeziehen, sobald die Offenlegungsquoten ausreichend

sind. In der Zwischenzeit erfolgt eine ESG-Überwachung, bei der unter anderem regelmäßige Screenings auf Verstöße gegen die UNGC-Vorgaben durchgeführt werden. JSS strebt eine Berücksichtigung dieses Indikators an, sobald sich die Datenzuverlässigkeit und -verfügbarkeit verbessern.

Engagement in umstrittenen Waffen (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS wird seiner Verantwortung in Bezug auf umstrittene Waffen aktiv gerecht, indem es sie konzernweit ausschließt. JSS investiert keine Eigenmittel in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich der umstrittenen Waffen tätig sind. Ferner übernimmt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für solche Unternehmen bzw. keine Dienstleistungen im Zusammenhang mit Kapitalmärkten oder Fusionen und Übernahmen.

Staaten

THG-Emissionsintensität (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die externen Umweltkosten eines Landes. Bewertet werden unter anderem die Treibhausgasemissionen pro Kopf.

Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Landes in Bezug auf Grundrechte.



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 – 30.06.2024

Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	9,68	TW
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,98	KR
TENCENT HOLDINGS LTD	Information und Kommunikation	4,81	CN
MEDIATEK INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,85	TW
INFOSYS LTD	Information und Kommunikation	1,69	IN
HANWHA SOLUTIONS CORP	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,63	KR
SK HYNIX INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,55	KR
ASIAN PAINTS LTD	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,49	IN
LG CHEM LTD-PREFERENCE	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,39	KR
LG CHEM LTD	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,28	KR
WEG SA	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,28	BR
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	Information und Kommunikation	1,27	IN
CCR SA	Baugewerbe/Bau	1,01	BR
HDFC BANK LIMITED	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,93	IN
LOCALIZA RENT A CAR	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,93	BR

Hauptinvestitionen per 30.06.2024 (Ende des Geschäftsjahres). Keine bedeutenden Abweichungen über das Geschäftsjahr.

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.



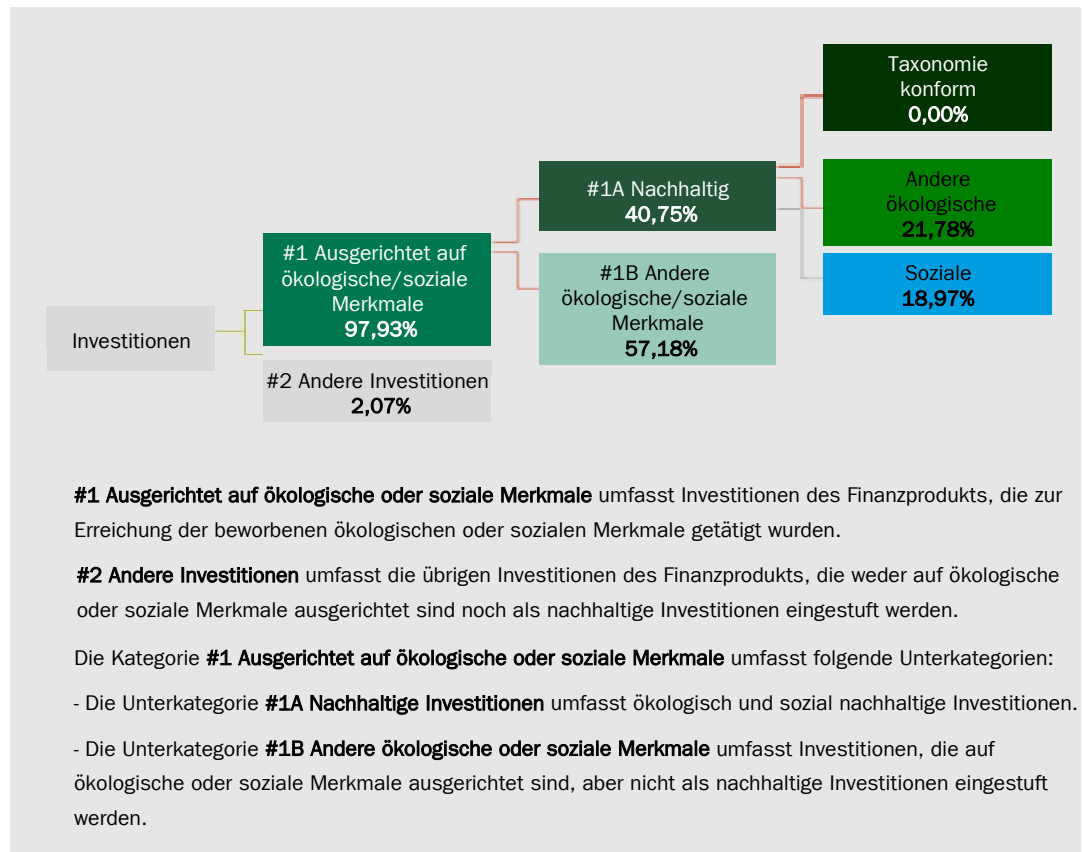
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 40,75%.

21,78% der Investitionen des Finanzprodukts waren ökologisch nachhaltige Investitionen, und 18,97% der Investitionen des Finanzprodukts waren sozial nachhaltige Investitionen. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Bezeichnung des Sektors	Anteil der Investitionen
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	13,95%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	11,51%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von elektronischen Bauelementen	9,68%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von chemischen Erzeugnissen	5,78%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Sonstige Kreditinstitute (ohne Spezialkreditinstitute)	5,63%
Information und Kommunikation – Sonstiges Verlagswesen (ohne Software)	4,81%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Beteiligungsgesellschaften	4,42%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Zentralbanken	2,52%
Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen – Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	2,33%
Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden – Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	2,08%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Fondsmanagement	1,86%
Information und Kommunikation – Erbringung von Beratungsleistungen auf dem Gebiet der Informationstechnologie	1,69%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von elektrischen Ausrüstungen	1,51%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Körperpflegemitteln und Duftstoffen	1,49%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Lebensversicherungen	1,45%
Erbringung von sonstigen Dienstleistungen – Erbringung von sonstigen Dienstleistungen	1,44%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von pharmazeutischen Erzeugnissen	1,36%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Spezialkreditinstitute	1,34%
Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Grundstücks- und Wohnungswesen	1,28%
Andere	23,86%

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** enthalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend; dieses Finanzprodukt hat sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel verpflichtet, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert(1)?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

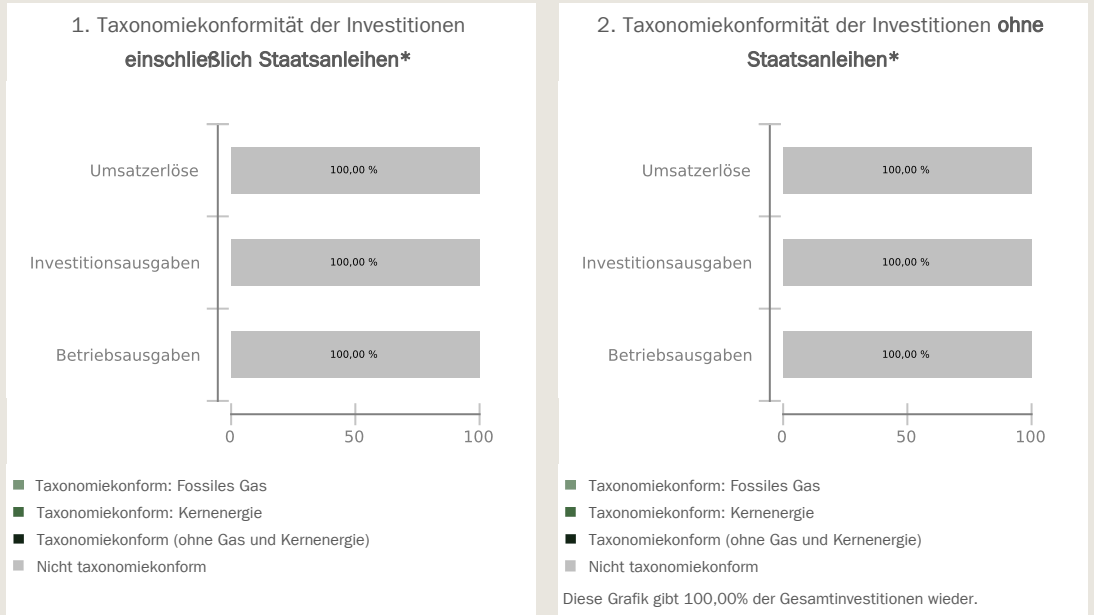
Nein

(1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind: 0,00%

Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind: 0,00%

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen	Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen (J-1)
0,00%	0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden: 21,78%

Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein; allerdings ist der Anlageverwalter gegenwärtig nicht in der Lage, den Anteil der zugrundeliegenden Investitionen des Finanzprodukts, berechnet gemäß der EU-Taxonomie, genau anzugeben. Diese Position wird jedoch weiterhin geprüft, während die zugrundeliegenden Regelungen im Laufe der Zeit fertiggestellt und mehr zuverlässige Daten verfügbar werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen: 18,97%



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts folgte einem rigorosen Verfahren, bei dem durchgängig ESG-Aspekte berücksichtigt wurden. Der Anlageverwalter wendete bei seiner Strategie die folgenden verbindlichen Kriterien an:

(a) Ausschluss von Anlagen in umstrittenen Geschäftsaktivitäten gemäß den Ausschlussrichtlinien von JSS;

(b) Erreichung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte nicht in mit C oder D bewertete Emittenten.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Name des Produkts: JSS Investmentfonds SICAV – JSS Sustainable Equity – Global Dividend
 Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300854KOPYVIM6U93

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : __% <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 75,78% an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt integriert umweltbezogene, soziale und die Unternehmensführung betreffende Aspekte („ESG“) in den Investitionsprozess mit dem Ziel, ein überdurchschnittlich gutes ESG-Profil für das gesamte Portfolio gemäß der von J. Safra Sarasin („JSS“) entwickelten Nachhaltigkeitsmatrix zu erreichen.

Das ESG-Rating von JSS bewertet die Emittenten im Verhältnis zu ihrer Vergleichsgruppe und reicht von A für Emittenten, die in die Spitzenklasse eingestuft werden, bis zu D für Emittenten, die ggf. eine umstrittene Geschäftstätigkeit ausüben. Beim nachhaltigen Investieren werden Emittenten, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und bei denen die Wahrscheinlichkeit für erhebliche Beeinträchtigungen daher erhöht ist, mit C (schlechteste Leistung im Branchenvergleich) oder D (wegen umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse von Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, die Kreditratings von Staaten unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien zu analysieren. JSS misst die nachhaltige Wirtschaftsleistung eines Landes nach (i) der Verfügbarkeit von natürlichen Ressourcen und (ii) danach, wie effizient diese eingesetzt werden. Die Nachhaltigkeitsbewertungen von Ländern stellen ein ergänzendes Instrument der finanziellen Analyse ihrer Kreditratings dar.

Folgende Ausschlusskriterien (mit Umsatzschwellen) wurden im Berichtszeitraum auf das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Waffenarten, die angesichts ihrer langfristigen humanitären Folgen und/oder der großen Anzahl ziviler Opfer bei ihrem Einsatz als umstritten

eingestuft werden. Dazu zählen u. a. biologische, chemische und atomare Waffen, Streumunition und Anti-Personenminen (Umsatzschwelle: 0%);

- Verteidigung und Rüstung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und wesentliche Bauteile) sowie Hilfssysteme und Dienstleistungen im Zusammenhang mit Waffen (Waffeneinsatzsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5%);

- Kohle: Unternehmen, die in erheblichem Umfang im Kohlegeschäft tätig sind und zugleich keine solide Strategie für den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft vorweisen können (Umsatzschwelle: 5% für den Kohlebergbau, 10% für die Kohleverstromung sowie 10% für die Summe aus beiden Komponenten);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen zwecks landwirtschaftlicher Nutzung gentechnisch verändern (Umsatzschwelle: 0%);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0%);

- Tabak: Hersteller von Tabakprodukten (Umsatzschwelle: 5%);

- Erwachsenenunterhaltung: Produzenten von Erwachsenenunterhaltung (Umsatzschwelle: 5%);

- Verstöße gegen Menschenrechte und sonstige Prinzipien des Global Compact: Unternehmen, die nach Maßgabe anerkannter internationaler Standards an schweren Verstößen gegen Menschenrechte oder sonstige Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen beteiligt sind (Umsatzschwelle: 0%).

- Palmöl: Unternehmen mit einem Bezug zu Palmöl ohne ausreichende Zertifizierung durch den Roundtable on Sustainable Palm Oil („RSPO“) werden ausgeschlossen (Umsatzschwelle: 5% für Palmölproduzenten, wenn weniger als 75% der Standorte eine RSPO-Zertifizierung besitzen).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Zeitpunkt dar. Bei nachhaltigen Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem sozialen Ziel beitragen, wird davon ausgegangen, dass sie zu beiden gleichermaßen beitragen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● *Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?*

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	93
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	7

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators (J-1)
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	93	85
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	7	15

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der CO₂-Emissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren Zielen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) in Einklang stehen, oder durch die Einnahme einer Spitzenposition im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren innerhalb der Vergleichsgruppe.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Prüfung auf erhebliche Beeinträchtigungen (Do no significant harm, „DSNH“) schließt Emittenten aus, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellenwerte der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen nicht erreichen. Ein Emittent besteht die Prüfung, wenn er nach der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Bewertung A oder B erhält. Wenn der Emittent im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist, muss er außerdem über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügen, um die Prüfung zu bestehen. Zu den Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen gehören Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie Kraftwerks- und Koks Kohle.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen nach Maßgabe der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen im Rahmen des Investitionsprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten negativen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Investitionen erreicht, die die ökologischen oder sozialen Mindestschwellenwerte nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Mitwirkungsmaßnahmen dienen der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Die Definition des ESG-Auswahlverfahrens und Anlageuniversums beruht auf den

Richtlinien und der Strategie von JSS für nachhaltiges Investieren, in denen die Prinzipien mehrerer internationaler Übereinkommen und Normen enthalten sind, u. a.:

Die Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen,

Die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

Der Global Compact der Vereinten Nationen,

Die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

Die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

Die Grundsätze zu Kinderrechten und unternehmerischem Handeln,

Die Arbeitsstandards der ILO,

Die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

Das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

Das Übereinkommen über Streumunition.

Der ESG-Auswahlprozess trägt dazu bei, börsennotierte Unternehmen zu ermitteln, die vermeintlich gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung verstoßen, wie in den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte vorgesehen. Diese Unternehmen werden als unvereinbar mit den o. a. Prinzipien erachtet und aus dem Universum nachhaltiger Investitionen von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Unternehmen

THG-Emissionen, CO₂-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind, Anteil des Verbrauchs und der Erzeugung von nicht erneuerbaren Energien, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (berücksichtigt für Ausschlüsse, Klimaversprechen und innerhalb der Nachhaltigkeitsmatrix)

Die schädlichsten Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe werden ausgeschlossen. Seit dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Umsätze aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 10\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 10\%$ aus einer Kombination aus dem Kraftwerkskohlebergbau und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

In Sektoren, in denen CO₂-Emissionen einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine CO₂-Emissionen. Dies umfasst eine Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Senkung der Emissionsintensität seines Kerngeschäfts, zur Senkung seines künftigen Energieverbrauchs oder seiner Treibhausgasemissionen (Scope 1, 2 und 3).

In Sektoren, in denen Möglichkeiten im Bereich der erneuerbaren Energien einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf erneuerbare Energien. Hierzu zählt auch die Bewertung der Kapazität eines Unternehmens im Bereich der erneuerbaren Energien.

Im Mai 2020 hat JSS ein Klimaversprechen abgegeben, das auf Klimaneutralität bis zum Jahr 2035 abzielt. Bei Fonds, bei denen dieses Versprechen bereits umgesetzt wurde, werden Treibhausgasemissionen anhand des CO₂-Fußabdrucks überwacht; diese Kontrollen werden für eine Teilmenge der Fonds durchgeführt. Die Einhaltung des Klimaversprechens wird mithilfe rückwärtsgerichteter Dekarbonisierungspfade überprüft, mit denen Übergangsrisiken gemindert werden sollen. Die meisten Fonds, die das Klimaversprechen umgesetzt haben, wenden folgende Methode an: Das ursprüngliche Ziel entspricht einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen des Referenzwerts um 30%. Diese Zielvorgabe wird in den folgenden Jahren um 7% verringert. Ab 2030 wird das Ziel linear gesenkt, bis das Netto-Null-Ziel im Jahr 2035 schließlich erreicht wird. Die THG-Emissionen des Portfolios auf der Grundlage der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro Mio. USD des Unternehmenswertes (EVIC) ausgedrückt.

Tätigkeiten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung wesentliche ESG-Faktoren darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf Biodiversität und Landnutzung. Hierzu zählt auch eine Bewertung der Auswirkungen der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens auf die Biodiversität. Zudem wird Palmöl konsequent ausgeschlossen.

Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Emissionen in Wasser (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Emissionen in Wasser erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Wasserbewirtschaftung. Die Wasserbewirtschaftung umfasst eine Bewertung wassereffizienter Produktionsprozesse, Trends bei der Wasserintensität sowie messbare, zeitlich befristete Zielvorgaben zur Senkung des Wasserverbrauchs. Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Gefährlicher Abfall (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Schadstoffemissionen und schädlichen Abfällen erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Schadstoffemissionen und seine Abfallwirtschaft. Der Umgang mit Schadstoffemissionen umfasst eine Bewertung der Bemühungen zur Kontrolle und Verringerung der Menge giftiger und krebserregender Nebenprodukte im Rahmen der Geschäftstätigkeit, Trends bei der Schadstofffreisetzung sowie messbare, zeitlich begrenzte Zielvorgaben zur Reduzierung von Schadstoffemissionen.

Verstöße gegen UNGC-Grundsätze (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Fehlende Prozesse zur Überwachung der Einhaltung des UNGC

Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Bestandteil der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Investitionsprozess einbeziehen, sobald die Offenlegungsquoten ausreichend

sind. In der Zwischenzeit erfolgt eine ESG-Überwachung, bei der unter anderem regelmäßige Screenings auf Verstöße gegen die UNGC-Vorgaben durchgeführt werden. JSS strebt eine Berücksichtigung dieses Indikators an, sobald sich die Datenzuverlässigkeit und -verfügbarkeit verbessern.

Engagement in umstrittenen Waffen (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS wird seiner Verantwortung in Bezug auf umstrittene Waffen aktiv gerecht, indem es sie konzernweit ausschließt. JSS investiert keine Eigenmittel in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich der umstrittenen Waffen tätig sind. Ferner übernimmt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für solche Unternehmen bzw. keine Dienstleistungen im Zusammenhang mit Kapitalmärkten oder Fusionen und Übernahmen.

Staaten

THG-Emissionsintensität (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die externen Umweltkosten eines Landes. Bewertet werden unter anderem die Treibhausgasemissionen pro Kopf.

Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Landes in Bezug auf Grundrechte.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 – 30.06.2024

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
TEXAS INSTRUMENTS INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,98	US
EMERSON ELECTRIC CO	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,95	US
HOME DEPOT INC	Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,84	US
INTL BUSINESS MACHINES CORP	Information und Kommunikation	3,73	US
AMGEN INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,71	US
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,70	US
BROADCOM INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,65	US
ROYAL BANK OF CANADA	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	3,58	CA
PACCAR INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,51	US
PROCTER & GAMBLE CO/THE	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,40	US
MERCK & CO. INC.	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,39	US
DARDEN RESTAURANTS INC	Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	3,29	US
ILLINOIS TOOL WORKS	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,19	US
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	Verkehr und Lagerei	3,18	US

Hauptinvestitionen per 30.06.2024 (Ende des Geschäftsjahres). Keine bedeutenden Abweichungen über das Geschäftsjahr.

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.



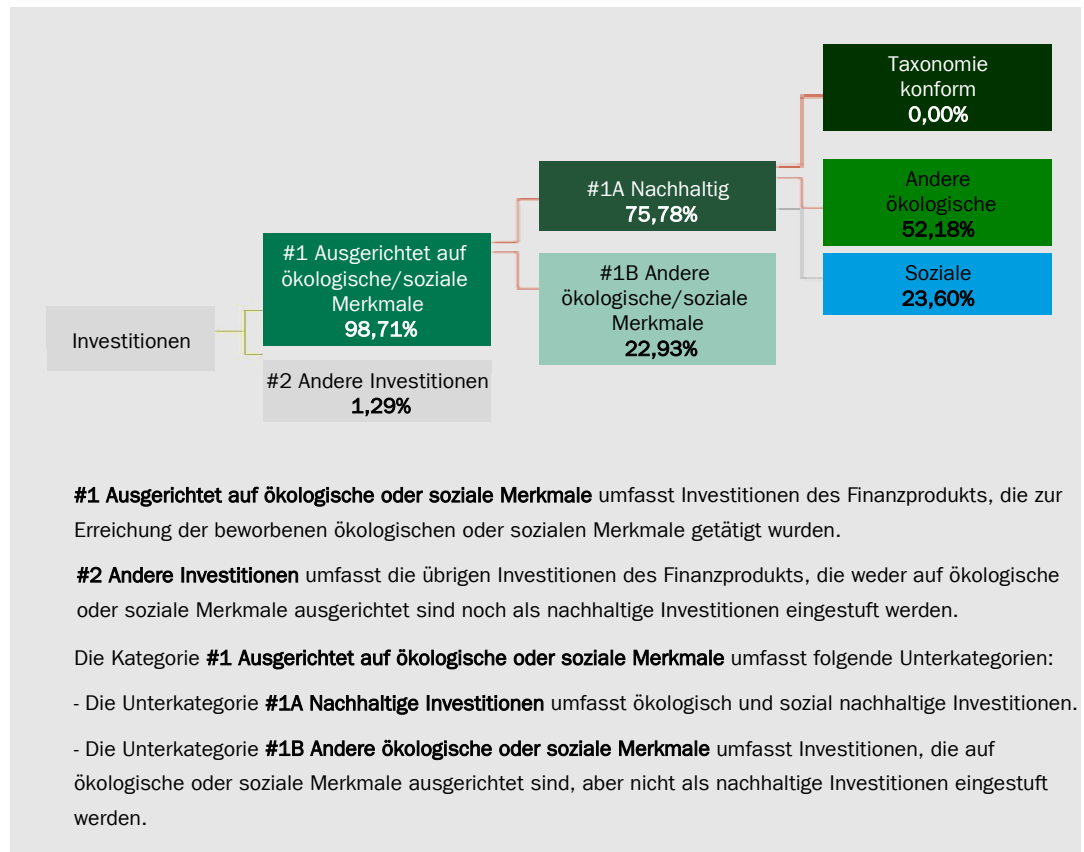
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 75,78%.

52,18% der Investitionen des Finanzprodukts waren ökologisch nachhaltige Investitionen, und 23,6% der Investitionen des Finanzprodukts waren sozial nachhaltige Investitionen. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Bezeichnung des Sektors	Anteil der Investitionen
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von pharmazeutischen Erzeugnissen	15,83%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Maschinenbau	9,95%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von elektronischen Bauelementen	7,35%
Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen – Einzelhandel (ohne Handel mit Kraftfahrzeugen)	5,76%
Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie – Gastronomie	4,99%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	3,98%
Information und Kommunikation – Erbringung von Beratungsleistungen auf dem Gebiet der Informationstechnologie	3,73%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Sonstige Kreditinstitute (ohne Spezialkreditinstitute)	3,58%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Automobilen und Automobilteilen	3,51%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Seifen, Wasch- und Reinigungsmitteln	3,40%
Verkehr und Lagerei – Post-, Kurier- und Expressdienste	3,18%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Nichtlebensversicherung	2,90%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Erfrischungsgetränken; Gewinnung natürlicher Mineralwässer	2,78%
Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Effekten- und Warenbörsen	2,72%
Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen – Sonstige Forschung und Entwicklung im Bereich Natur-, Ingenieur-, Agrarwissenschaften und Medizin	2,71%
Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie – Restaurants, Gaststätten, Imbissstuben, Cafés, Eissalons u. Ä.	2,63%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Lebensversicherungen	2,63%
Information und Kommunikation – Drahtlose Telekommunikation	1,91%
Verkehr und Lagerei – Verkehr und Lagerei	1,88%
Andere	14,58%

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** enthalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend; dieses Finanzprodukt hat sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel verpflichtet, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert(1)?**

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

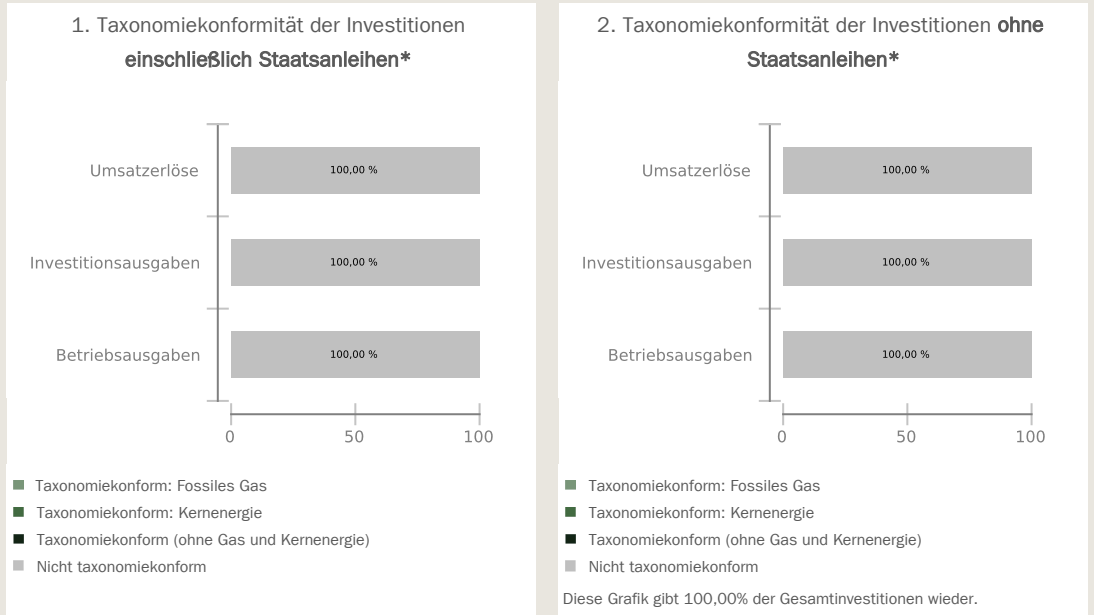
Nein

(1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind: 0,00%

Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind: 0,00%

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen	Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen (J-1)
0,00%	0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden: 52,18%

Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein; allerdings ist der Anlageverwalter gegenwärtig nicht in der Lage, den Anteil der zugrundeliegenden Investitionen des Finanzprodukts, berechnet gemäß der EU-Taxonomie, genau anzugeben. Diese Position wird jedoch weiterhin geprüft, während die zugrundeliegenden Regelungen im Laufe der Zeit fertiggestellt und mehr zuverlässige Daten verfügbar werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen: 23,60%



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts folgte einem rigorosen Verfahren, bei dem durchgängig ESG-Aspekte berücksichtigt wurden. Der Anlageverwalter wendete bei seiner Strategie die folgenden verbindlichen Kriterien an:

(a) Ausschluss von Anlagen in umstrittenen Geschäftsaktivitäten gemäß den Ausschlussrichtlinien von JSS;

(b) Erreichung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte nicht in mit C oder D bewertete Emittenten.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Name des Produkts: JSS Investmentfonds SICAV – JSS Sustainable Multi Asset – Thematic Balanced (EUR)
 Unternehmenskennung (LEI-Code): 5493009IXDIFQEFKEV17

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 84,43% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt integriert umweltbezogene, soziale und die Unternehmensführung betreffende Aspekte („ESG“) in den Investitionsprozess mit dem Ziel, ein überdurchschnittlich gutes ESG-Profil für das gesamte Portfolio gemäß der von J. Safra Sarasin („JSS“) entwickelten Nachhaltigkeitsmatrix zu erreichen.

Das ESG-Rating von JSS bewertet die Emittenten im Verhältnis zu ihrer Vergleichsgruppe und reicht von A für Emittenten, die in die Spitzenklasse eingestuft werden, bis zu D für Emittenten, die ggf. eine umstrittene Geschäftstätigkeit ausüben. Beim nachhaltigen Investieren werden Emittenten, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und bei denen die Wahrscheinlichkeit für erhebliche Beeinträchtigungen daher erhöht ist, mit C (schlechteste Leistung im Branchenvergleich) oder D (wegen umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse von Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, die Kreditratings von Staaten unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien zu analysieren. JSS misst die nachhaltige Wirtschaftsleistung eines Landes nach (i) der Verfügbarkeit von natürlichen Ressourcen und (ii) danach, wie effizient diese eingesetzt werden. Die Nachhaltigkeitsbewertungen von Ländern stellen ein ergänzendes Instrument der finanziellen Analyse ihrer Kreditratings dar.

Folgende Ausschlusskriterien (mit Umsatzschwellen) wurden im Berichtszeitraum auf das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Waffenarten, die angesichts ihrer langfristigen humanitären Folgen und/oder der großen Anzahl ziviler Opfer bei ihrem Einsatz als umstritten

eingestuft werden. Dazu zählen u. a. biologische, chemische und atomare Waffen, Streumunition und Anti-Personenminen (Umsatzschwelle: 0%);

- Verteidigung und Rüstung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und wesentliche Bauteile) sowie Hilfssysteme und Dienstleistungen im Zusammenhang mit Waffen (Waffeneinsatzsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5%);

- Kohle: Unternehmen, die in erheblichem Umfang im Kohlegeschäft tätig sind und zugleich keine solide Strategie für den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft vorweisen können (Umsatzschwelle: 5% für den Kohlebergbau, 10% für die Kohleverstromung sowie 10% für die Summe aus beiden Komponenten);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen zwecks landwirtschaftlicher Nutzung gentechnisch verändern (Umsatzschwelle: 0%);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0%);

- Tabak: Hersteller von Tabakprodukten (Umsatzschwelle: 5%);

- Erwachsenenunterhaltung: Produzenten von Erwachsenenunterhaltung (Umsatzschwelle: 5%);

- Verstöße gegen Menschenrechte und sonstige Prinzipien des Global Compact: Unternehmen, die nach Maßgabe anerkannter internationaler Standards an schweren Verstößen gegen Menschenrechte oder sonstige Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen beteiligt sind (Umsatzschwelle: 0%).

- Palmöl: Unternehmen mit einem Bezug zu Palmöl ohne ausreichende Zertifizierung durch den Roundtable on Sustainable Palm Oil („RSPO“) werden ausgeschlossen (Umsatzschwelle: 5% für Palmölproduzenten, wenn weniger als 75% der Standorte eine RSPO-Zertifizierung besitzen).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Zeitpunkt dar. Bei nachhaltigen Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem sozialen Ziel beitragen, wird davon ausgegangen, dass sie zu beiden gleichermaßen beitragen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● *Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?*

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	95
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	5

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators (J-1)
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	95	94
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	5	5

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der CO₂-Emissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren Zielen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) in Einklang stehen, oder durch die Einnahme einer Spitzenposition im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren innerhalb der Vergleichsgruppe.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Prüfung auf erhebliche Beeinträchtigungen (Do no significant harm, „DSNH“) schließt Emittenten aus, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellenwerte der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen nicht erreichen. Ein Emittent besteht die Prüfung, wenn er nach der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Bewertung A oder B erhält. Wenn der Emittent im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist, muss er außerdem über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügen, um die Prüfung zu bestehen. Zu den Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen gehören Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie Kraftwerks- und Koks Kohle.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen nach Maßgabe der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen im Rahmen des Investitionsprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten negativen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Investitionen erreicht, die die ökologischen oder sozialen Mindestschwellenwerte nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Mitwirkungsmaßnahmen dienen der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Die Definition des ESG-Auswahlverfahrens und Anlageuniversums beruht auf den

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Richtlinien und der Strategie von JSS für nachhaltiges Investieren, in denen die Prinzipien mehrerer internationaler Übereinkommen und Normen enthalten sind, u. a.:

Die Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen,

Die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

Der Global Compact der Vereinten Nationen,

Die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

Die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

Die Grundsätze zu Kinderrechten und unternehmerischem Handeln,

Die Arbeitsstandards der ILO,

Die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

Das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

Das Übereinkommen über Streumunition.

Der ESG-Auswahlprozess trägt dazu bei, börsennotierte Unternehmen zu ermitteln, die vermeintlich gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung verstoßen, wie in den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte vorgesehen. Diese Unternehmen werden als unvereinbar mit den o. a. Prinzipien erachtet und aus dem Universum nachhaltiger Investitionen von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Unternehmen

THG-Emissionen, CO₂-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind, Anteil des Verbrauchs und der Erzeugung von nicht erneuerbaren Energien, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (berücksichtigt für Ausschlüsse, Klimaversprechen und innerhalb der Nachhaltigkeitsmatrix)

Die schädlichsten Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe werden ausgeschlossen. Seit dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Umsätze aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 10\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 10\%$ aus einer Kombination aus dem Kraftwerkskohlebergbau und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

In Sektoren, in denen CO₂-Emissionen einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine CO₂-Emissionen. Dies umfasst eine Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Senkung der Emissionsintensität seines Kerngeschäfts, zur Senkung seines künftigen Energieverbrauchs oder seiner Treibhausgasemissionen (Scope 1, 2 und 3).

In Sektoren, in denen Möglichkeiten im Bereich der erneuerbaren Energien einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf erneuerbare Energien. Hierzu zählt auch die Bewertung der Kapazität eines Unternehmens im Bereich der erneuerbaren Energien.

Im Mai 2020 hat JSS ein Klimaversprechen abgegeben, das auf Klimaneutralität bis zum Jahr 2035 abzielt. Bei Fonds, bei denen dieses Versprechen bereits umgesetzt wurde, werden Treibhausgasemissionen anhand des CO₂-Fußabdrucks überwacht; diese Kontrollen werden für eine Teilmenge der Fonds durchgeführt. Die Einhaltung des Klimaversprechens wird mithilfe rückwärtsgerichteter Dekarbonisierungspfade überprüft, mit denen Übergangsrisiken gemindert werden sollen. Die meisten Fonds, die das Klimaversprechen umgesetzt haben, wenden folgende Methode an: Das ursprüngliche Ziel entspricht einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen des Referenzwerts um 30%. Diese Zielvorgabe wird in den folgenden Jahren um 7% verringert. Ab 2030 wird das Ziel linear gesenkt, bis das Netto-Null-Ziel im Jahr 2035 schließlich erreicht wird. Die THG-Emissionen des Portfolios auf der Grundlage der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro Mio. USD des Unternehmenswertes (EVIC) ausgedrückt.

Tätigkeiten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung wesentliche ESG-Faktoren darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf Biodiversität und Landnutzung. Hierzu zählt auch eine Bewertung der Auswirkungen der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens auf die Biodiversität. Zudem wird Palmöl konsequent ausgeschlossen.

Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Emissionen in Wasser (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Emissionen in Wasser erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Wasserbewirtschaftung. Die Wasserbewirtschaftung umfasst eine Bewertung wassereffizienter Produktionsprozesse, Trends bei der Wasserintensität sowie messbare, zeitlich befristete Zielvorgaben zur Senkung des Wasserverbrauchs. Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Gefährlicher Abfall (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Schadstoffemissionen und schädlichen Abfällen erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Schadstoffemissionen und seine Abfallwirtschaft. Der Umgang mit Schadstoffemissionen umfasst eine Bewertung der Bemühungen zur Kontrolle und Verringerung der Menge giftiger und krebserregender Nebenprodukte im Rahmen der Geschäftstätigkeit, Trends bei der Schadstofffreisetzung sowie messbare, zeitlich begrenzte Zielvorgaben zur Reduzierung von Schadstoffemissionen.

Verstöße gegen UNGC-Grundsätze (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Fehlende Prozesse zur Überwachung der Einhaltung des UNGC

Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Bestandteil der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Investitionsprozess einbeziehen, sobald die Offenlegungsquoten ausreichend

sind. In der Zwischenzeit erfolgt eine ESG-Überwachung, bei der unter anderem regelmäßige Screenings auf Verstöße gegen die UNGC-Vorgaben durchgeführt werden. JSS strebt eine Berücksichtigung dieses Indikators an, sobald sich die Datenzuverlässigkeit und -verfügbarkeit verbessern.

Engagement in umstrittenen Waffen (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS wird seiner Verantwortung in Bezug auf umstrittene Waffen aktiv gerecht, indem es sie konzernweit ausschließt. JSS investiert keine Eigenmittel in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich der umstrittenen Waffen tätig sind. Ferner übernimmt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für solche Unternehmen bzw. keine Dienstleistungen im Zusammenhang mit Kapitalmärkten oder Fusionen und Übernahmen.

Staaten

THG-Emissionsintensität (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die externen Umweltkosten eines Landes. Bewertet werden unter anderem die Treibhausgasemissionen pro Kopf.

Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Landes in Bezug auf Grundrechte.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:
01.07.2023 – 30.06.2024

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
NVIDIA CORP	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,83	US
APPLE INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,82	US
MICROSOFT CORP	Information und Kommunikation	3,50	US
AMAZON.COM INC	Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,36	US
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	3,00	DE
ALPHABET INC-CL A	Information und Kommunikation	2,97	US
FRANKREICH (REGIERUNG VON)	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	2,73	FR
ASML HOLDING NV	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,41	NL
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	2,23	ES
ZOETIS INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,12	US
OTIS WORLDWIDE CORP	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,77	US
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,73	FR
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	1,66	ES
MOODY'S CORP	Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	1,56	US
HOME DEPOT INC	Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	1,52	US

Hauptinvestitionen per 30.06.2024 (Ende des Geschäftsjahres). Keine bedeutenden Abweichungen über das Geschäftsjahr.

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Die Gewichtung von Anleihen wird ermittelt, indem der Marktpreis der Anleihe (einschließlich aufgelaufener Zinsen) durch das Gesamtvermögen des Teilfonds geteilt wird.

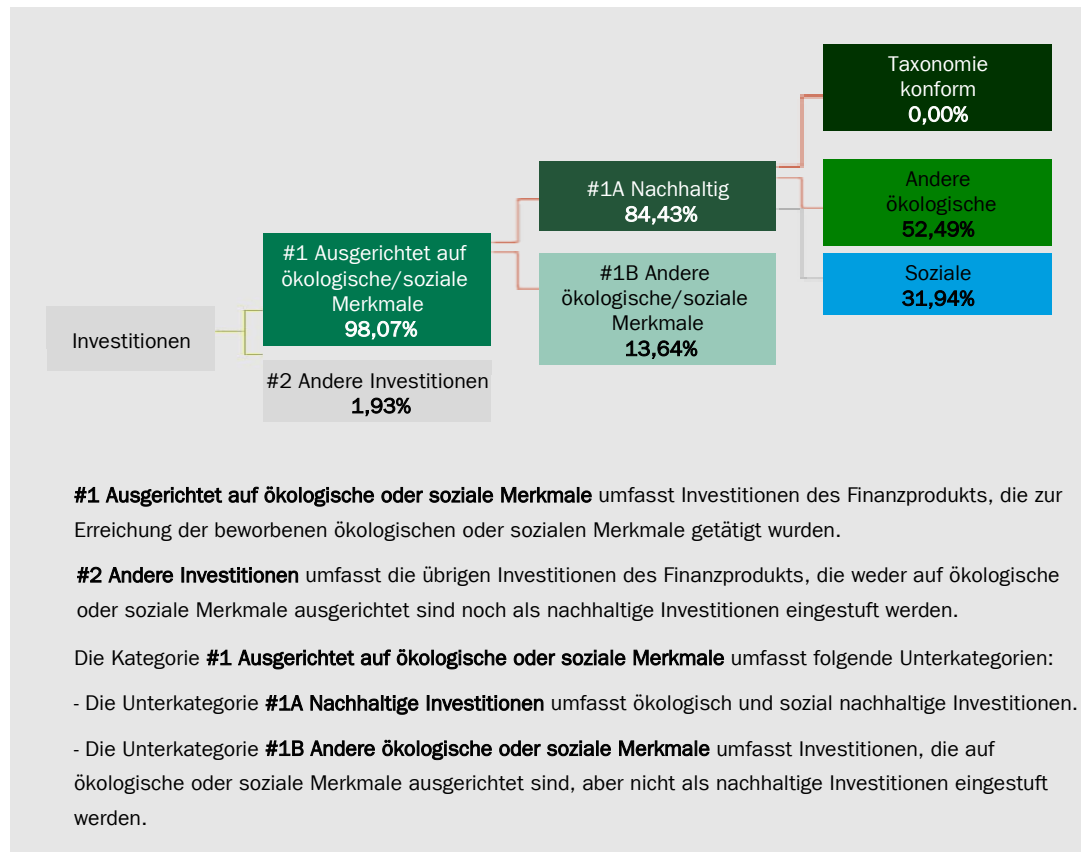


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 84,43%. 52,49% der Investitionen des Finanzprodukts waren ökologisch nachhaltige Investitionen, und 31,94% der Investitionen des Finanzprodukts waren sozial nachhaltige Investitionen. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Bezeichnung des Sektors	Anteil der Investitionen
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung – Allgemeine öffentliche Verwaltung	11,21%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von elektronischen Bauelementen	6,56%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Sonstige Kreditinstitute (ohne Spezialkreditinstitute)	5,08%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von pharmazeutischen Erzeugnissen	4,16%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Fondsmanagement	3,95%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Geräten und Einrichtungen der Telekommunikationstechnik	3,82%
Information und Kommunikation – Verlegen von sonstiger Software	3,50%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von pharmazeutischen Erzeugnissen	3,40%
Handel mit Kraftfahrzeugen; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen – Versand- und Internet-Einzelhandel	3,36%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	3,19%
Information und Kommunikation – Webportale	2,97%
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung – Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	2,73%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	2,57%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Maschinen für sonstige bestimmte Wirtschaftszweige a. n. g.	2,41%
Information und Kommunikation – Drahtlose Telekommunikation	2,36%
Information und Kommunikation – Programmierungstätigkeiten	2,04%
Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen – Einzelhandel (ohne Handel mit Kraftfahrzeugen)	2,00%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Sonstige Finanzdienstleistungen außer Versicherungen und Pensionskassen (nicht anderweitig erfasst)	1,87%
Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Effekten- und Warenbörsen	1,86%
Andere	30,96%

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** enthalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend; dieses Finanzprodukt hat sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel verpflichtet, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert(1)?**

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

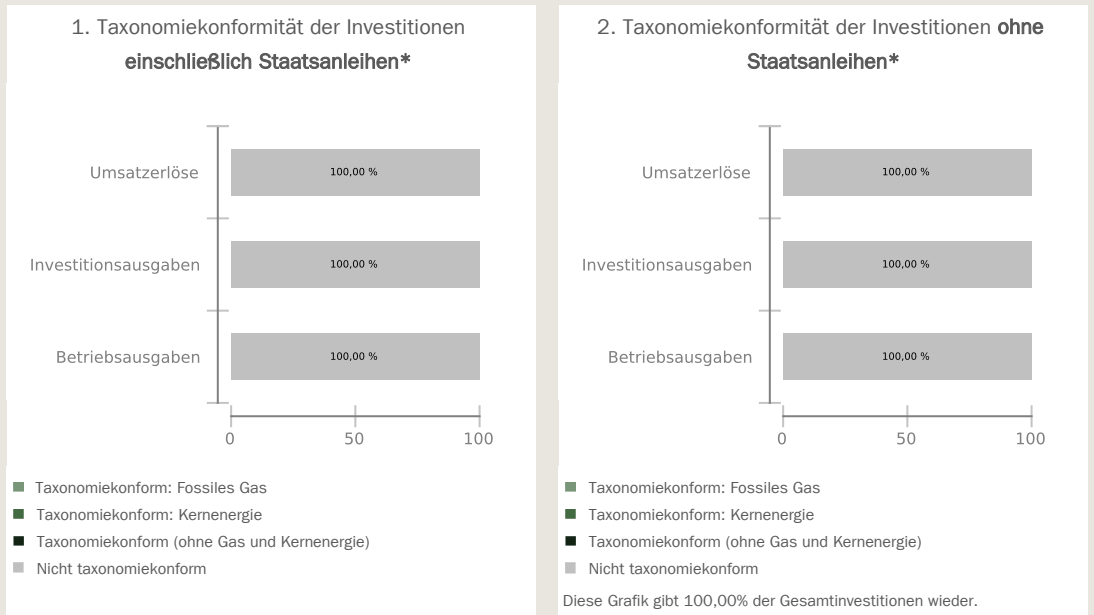
Nein

(1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind: 0,00%

Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind: 0,00%

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen	Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen (J-1)
0,00%	0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden: 52,49%

Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein; allerdings ist der Anlageverwalter gegenwärtig nicht in der Lage, den Anteil der zugrundeliegenden Investitionen des Finanzprodukts, berechnet gemäß der EU-Taxonomie, genau anzugeben. Diese Position wird jedoch weiterhin geprüft, während die zugrundeliegenden Regelungen im Laufe der Zeit fertiggestellt und mehr zuverlässige Daten verfügbar werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen: 31,94%



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts folgte einem rigorosen Verfahren, bei dem durchgängig ESG-Aspekte berücksichtigt wurden. Der Anlageverwalter wendete bei seiner Strategie die folgenden verbindlichen Kriterien an:

(a) Ausschluss von Anlagen in umstrittenen Geschäftsaktivitäten gemäß den Ausschlussrichtlinien von JSS;

(b) Erreichung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte nicht in mit C oder D bewertete Emittenten.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Name des Produkts: JSS Investmentfonds SICAV – JSS Twelve Sustainable Insurance Bond
 Unternehmenskennung (LEI-Code): 5493007PBLH88KG1CD22

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : __% <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 57,68% an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt integriert umweltbezogene, soziale und die Unternehmensführung betreffende Aspekte („ESG“) in den Investitionsprozess mit dem Ziel, ein überdurchschnittlich gutes ESG-Profil für das gesamte Portfolio gemäß der von J. Safra Sarasin („JSS“) entwickelten Nachhaltigkeitsmatrix zu erreichen.

Das ESG-Rating von JSS bewertet die Emittenten im Verhältnis zu ihrer Vergleichsgruppe und reicht von A für Emittenten, die in die Spitzenklasse eingestuft werden, bis zu D für Emittenten, die ggf. eine umstrittene Geschäftstätigkeit ausüben. Beim nachhaltigen Investieren werden Emittenten, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und bei denen die Wahrscheinlichkeit für erhebliche Beeinträchtigungen daher erhöht ist, mit C (schlechteste Leistung im Branchenvergleich) oder D (wegen umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse von Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, die Kreditratings von Staaten unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien zu analysieren. JSS misst die nachhaltige Wirtschaftsleistung eines Landes nach (i) der Verfügbarkeit von natürlichen Ressourcen und (ii) danach, wie effizient diese eingesetzt werden. Die Nachhaltigkeitsbewertungen von Ländern stellen ein ergänzendes Instrument der finanziellen Analyse ihrer Kreditratings dar.

Folgende Ausschlusskriterien (mit Umsatzschwellen) wurden im Berichtszeitraum auf das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Waffenarten, die angesichts ihrer langfristigen humanitären Folgen und/oder der großen Anzahl ziviler Opfer bei ihrem Einsatz als umstritten

eingestuft werden. Dazu zählen u. a. biologische, chemische und atomare Waffen, Streumunition und Anti-Personenminen (Umsatzschwelle: 0%);

- Verteidigung und Rüstung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und wesentliche Bauteile) sowie Hilfssysteme und Dienstleistungen im Zusammenhang mit Waffen (Waffeneinsatzsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5%);

- Kohle: Unternehmen, die in erheblichem Umfang im Kohlegeschäft tätig sind und zugleich keine solide Strategie für den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft vorweisen können (Umsatzschwelle: 5% für den Kohlebergbau, 10% für die Kohleverstromung sowie 10% für die Summe aus beiden Komponenten);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen zwecks landwirtschaftlicher Nutzung gentechnisch verändern (Umsatzschwelle: 0%);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0%);

- Tabak: Hersteller von Tabakprodukten (Umsatzschwelle: 5%);

- Erwachsenenunterhaltung: Produzenten von Erwachsenenunterhaltung (Umsatzschwelle: 5%);

- Verstöße gegen Menschenrechte und sonstige Prinzipien des Global Compact: Unternehmen, die nach Maßgabe anerkannter internationaler Standards an schweren Verstößen gegen Menschenrechte oder sonstige Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen beteiligt sind (Umsatzschwelle: 0%).

- Palmöl: Unternehmen mit einem Bezug zu Palmöl ohne ausreichende Zertifizierung durch den Roundtable on Sustainable Palm Oil („RSPO“) werden ausgeschlossen (Umsatzschwelle: 5% für Palmölproduzenten, wenn weniger als 75% der Standorte eine RSPO-Zertifizierung besitzen).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Zeitpunkt dar. Bei nachhaltigen Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem sozialen Ziel beitragen, wird davon ausgegangen, dass sie zu beiden gleichermaßen beitragen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● *Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?*

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	100
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	0

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators (J-1)
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	100	97
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	0	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der CO₂-Emissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren Zielen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) in Einklang stehen, oder durch die Einnahme einer Spitzenposition im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren innerhalb der Vergleichsgruppe.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Prüfung auf erhebliche Beeinträchtigungen (Do no significant harm, „DSNH“) schließt Emittenten aus, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellenwerte der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen nicht erreichen. Ein Emittent besteht die Prüfung, wenn er nach der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Bewertung A oder B erhält. Wenn der Emittent im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist, muss er außerdem über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügen, um die Prüfung zu bestehen. Zu den Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen gehören Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie Kraftwerks- und Koks Kohle.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen nach Maßgabe der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen im Rahmen des Investitionsprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten negativen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Investitionen erreicht, die die ökologischen oder sozialen Mindestschwellenwerte nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Mitwirkungsmaßnahmen dienen der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Die Definition des ESG-Auswahlverfahrens und Anlageuniversums beruht auf den

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Richtlinien und der Strategie von JSS für nachhaltiges Investieren, in denen die Prinzipien mehrerer internationaler Übereinkommen und Normen enthalten sind, u. a.:

Die Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen,

Die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

Der Global Compact der Vereinten Nationen,

Die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

Die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

Die Grundsätze zu Kinderrechten und unternehmerischem Handeln,

Die Arbeitsstandards der ILO,

Die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

Das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

Das Übereinkommen über Streumunition.

Der ESG-Auswahlprozess trägt dazu bei, börsennotierte Unternehmen zu ermitteln, die vermeintlich gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung verstoßen, wie in den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte vorgesehen. Diese Unternehmen werden als unvereinbar mit den o. a. Prinzipien erachtet und aus dem Universum nachhaltiger Investitionen von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Unternehmen

THG-Emissionen, CO₂-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind, Anteil des Verbrauchs und der Erzeugung von nicht erneuerbaren Energien, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (berücksichtigt für Ausschlüsse, Klimaversprechen und innerhalb der Nachhaltigkeitsmatrix)

Die schädlichsten Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe werden ausgeschlossen. Seit dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Umsätze aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 10\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 10\%$ aus einer Kombination aus dem Kraftwerkskohlebergbau und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

In Sektoren, in denen CO₂-Emissionen einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine CO₂-Emissionen. Dies umfasst eine Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Senkung der Emissionsintensität seines Kerngeschäfts, zur Senkung seines künftigen Energieverbrauchs oder seiner Treibhausgasemissionen (Scope 1, 2 und 3).

In Sektoren, in denen Möglichkeiten im Bereich der erneuerbaren Energien einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf erneuerbare Energien. Hierzu zählt auch die Bewertung der Kapazität eines Unternehmens im Bereich der erneuerbaren Energien.

Im Mai 2020 hat JSS ein Klimaversprechen abgegeben, das auf Klimaneutralität bis zum Jahr 2035 abzielt. Bei Fonds, bei denen dieses Versprechen bereits umgesetzt wurde, werden Treibhausgasemissionen anhand des CO₂-Fußabdrucks überwacht; diese Kontrollen werden für eine Teilmenge der Fonds durchgeführt. Die Einhaltung des Klimaversprechens wird mithilfe rückwärtsgerichteter Dekarbonisierungspfade überprüft, mit denen Übergangsrisiken gemindert werden sollen. Die meisten Fonds, die das Klimaversprechen umgesetzt haben, wenden folgende Methode an: Das ursprüngliche Ziel entspricht einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen des Referenzwerts um 30%. Diese Zielvorgabe wird in den folgenden Jahren um 7% verringert. Ab 2030 wird das Ziel linear gesenkt, bis das Netto-Null-Ziel im Jahr 2035 schließlich erreicht wird. Die THG-Emissionen des Portfolios auf der Grundlage der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro Mio. USD des Unternehmenswertes (EVIC) ausgedrückt.

Tätigkeiten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung wesentliche ESG-Faktoren darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf Biodiversität und Landnutzung. Hierzu zählt auch eine Bewertung der Auswirkungen der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens auf die Biodiversität. Zudem wird Palmöl konsequent ausgeschlossen.

Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Emissionen in Wasser (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Emissionen in Wasser erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Wasserbewirtschaftung. Die Wasserbewirtschaftung umfasst eine Bewertung wassereffizienter Produktionsprozesse, Trends bei der Wasserintensität sowie messbare, zeitlich befristete Zielvorgaben zur Senkung des Wasserverbrauchs. Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Gefährlicher Abfall (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Schadstoffemissionen und schädlichen Abfällen erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Schadstoffemissionen und seine Abfallwirtschaft. Der Umgang mit Schadstoffemissionen umfasst eine Bewertung der Bemühungen zur Kontrolle und Verringerung der Menge giftiger und krebserregender Nebenprodukte im Rahmen der Geschäftstätigkeit, Trends bei der Schadstofffreisetzung sowie messbare, zeitlich begrenzte Zielvorgaben zur Reduzierung von Schadstoffemissionen.

Verstöße gegen UNGC-Grundsätze (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Fehlende Prozesse zur Überwachung der Einhaltung des UNGC

Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Bestandteil der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Investitionsprozess einbeziehen, sobald die Offenlegungsquoten ausreichend

sind. In der Zwischenzeit erfolgt eine ESG-Überwachung, bei der unter anderem regelmäßige Screenings auf Verstöße gegen die UNGC-Vorgaben durchgeführt werden. JSS strebt eine Berücksichtigung dieses Indikators an, sobald sich die Datenzuverlässigkeit und -verfügbarkeit verbessern.

Engagement in umstrittenen Waffen (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS wird seiner Verantwortung in Bezug auf umstrittene Waffen aktiv gerecht, indem es sie konzernweit ausschließt. JSS investiert keine Eigenmittel in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich der umstrittenen Waffen tätig sind. Ferner übernimmt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für solche Unternehmen bzw. keine Dienstleistungen im Zusammenhang mit Kapitalmärkten oder Fusionen und Übernahmen.

Staaten

THG-Emissionsintensität (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die externen Umweltkosten eines Landes. Bewertet werden unter anderem die Treibhausgasemissionen pro Kopf.

Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Landes in Bezug auf Grundrechte.



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 – 30.06.2024

Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
UNIQA INSURANCE GROUP AG	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	3,04	AT
ATHORA NETHERLANDS	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,40	NL
AXA SA	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,12	FR
PHOENIX GRP HLD PLC	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,07	GB
ROTHESAY LIFE	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,02	GB
QUILTER PLC	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,00	GB
HANNOVER RÜCK	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,97	DE
ASR NEDERLAND NV	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,96	NL
ELM BV (SWISS REIN CO)	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,86	NL
GENERTEL SPA	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,85	IT
NN GROUP NV	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,85	NL
AG INSURANCE SA/NV	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,82	BE
UTMOST GROUP	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,73	GB
ARGENTUM (SWISS LIFE)	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,67	NL
ROTHESAY LIFE	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,65	GB

Hauptinvestitionen per 30.06.2024 (Ende des Geschäftsjahres). Keine bedeutenden Abweichungen über das Geschäftsjahr.

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Die Gewichtung von Anleihen wird ermittelt, indem der Marktpreis der Anleihe (einschließlich aufgelaufener Zinsen) durch das Gesamtvermögen des Teilfonds geteilt wird.

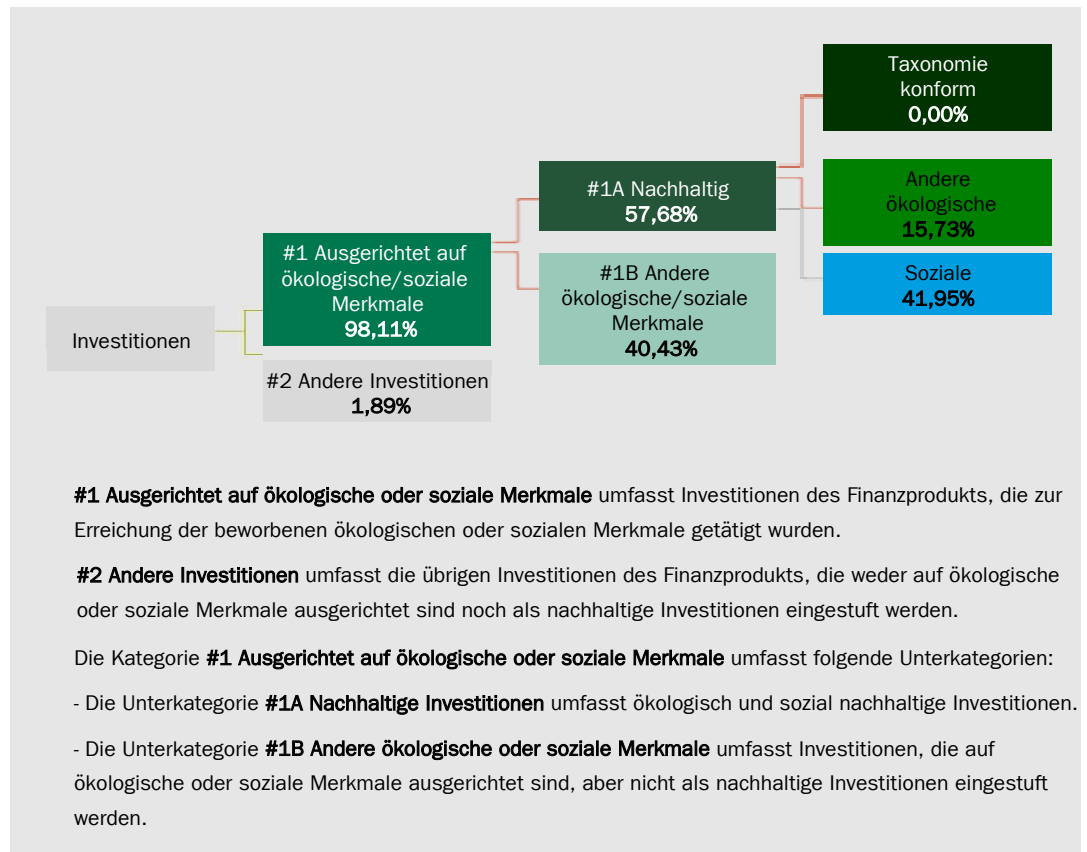


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 57,68%. 15,73% der Investitionen des Finanzprodukts waren ökologisch nachhaltige Investitionen, und 41,95% der Investitionen des Finanzprodukts waren sozial nachhaltige Investitionen. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.

● *In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?*

Bezeichnung des Sektors	Anteil der Investitionen
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Lebensversicherungen	60,19%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Nichtlebensversicherung	15,60%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Beteiligungsgesellschaften	11,05%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Rückversicherungen	6,81%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Fondsmanagement	4,14%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	1,67%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Sonstige Kreditinstitute (ohne Spezialkreditinstitute)	0,44%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Sonstige Finanzdienstleistungen außer Versicherungen und Pensionskassen (nicht anderweitig erfasst)	0,10%

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** enthalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend; dieses Finanzprodukt hat sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel verpflichtet, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert(1)?**

Ja:

In fossiles Gas In Kernenergie

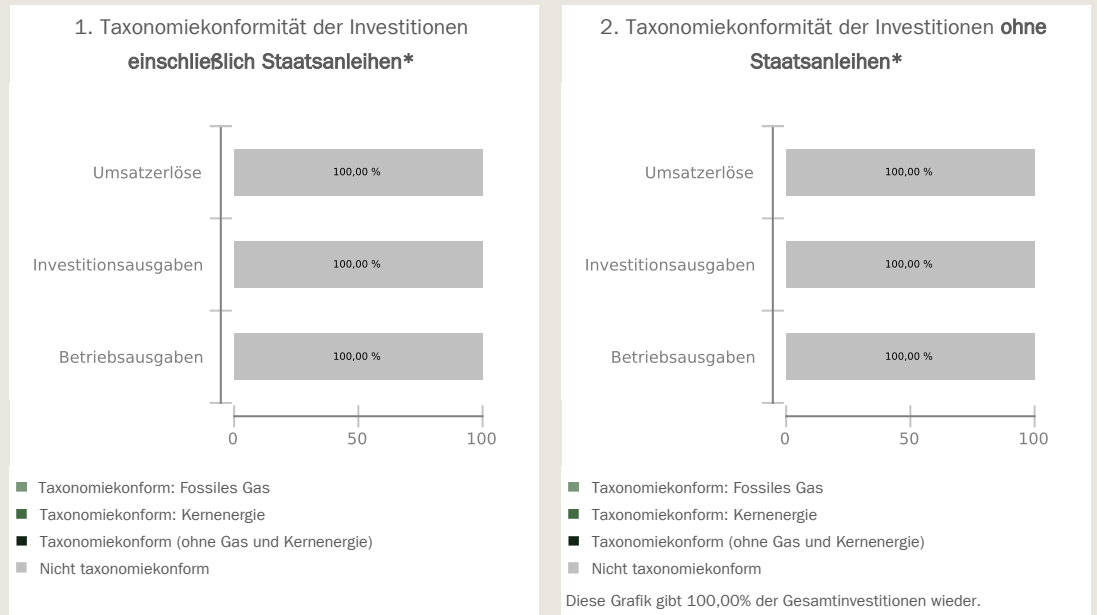
Nein

(1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind: 0,00%

Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind: 0,00%

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen	Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen (J-1)
0,00%	0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden: 15,73%

Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein; allerdings ist der Anlageverwalter gegenwärtig nicht in der Lage, den Anteil der zugrundeliegenden Investitionen des Finanzprodukts, berechnet gemäß der EU-Taxonomie, genau anzugeben. Diese Position wird jedoch weiterhin geprüft, während die zugrundeliegenden Regelungen im Laufe der Zeit fertiggestellt und mehr zuverlässige Daten verfügbar werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen: 41,95%



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts folgte einem rigorosen Verfahren, bei dem durchgängig ESG-Aspekte berücksichtigt wurden. Der Anlageverwalter wendete bei seiner Strategie die folgenden verbindlichen Kriterien an:

(a) Ausschluss von Anlagen in umstrittenen Geschäftsaktivitäten gemäß den Ausschlussrichtlinien von JSS;

(b) Erreichung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte nicht in mit C oder D bewertete Emittenten.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Name des Produkts: JSS Investmentfonds SICAV – JSS Sustainable Equity – Global Thematic
 Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300VK5T1MLG877860

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja		Nein	
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 83,45% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/>		<input type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt integriert umweltbezogene, soziale und die Unternehmensführung betreffende Aspekte („ESG“) in den Investitionsprozess mit dem Ziel, ein überdurchschnittlich gutes ESG-Profil für das gesamte Portfolio gemäß der von J. Safra Sarasin („JSS“) entwickelten Nachhaltigkeitsmatrix zu erreichen.

Das ESG-Rating von JSS bewertet die Emittenten im Verhältnis zu ihrer Vergleichsgruppe und reicht von A für Emittenten, die in die Spitzenklasse eingestuft werden, bis zu D für Emittenten, die ggf. eine umstrittene Geschäftstätigkeit ausüben. Beim nachhaltigen Investieren werden Emittenten, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und bei denen die Wahrscheinlichkeit für erhebliche Beeinträchtigungen daher erhöht ist, mit C (schlechteste Leistung im Branchenvergleich) oder D (wegen umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse von Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, die Kreditratings von Staaten unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien zu analysieren. JSS misst die nachhaltige Wirtschaftsleistung eines Landes nach (i) der Verfügbarkeit von natürlichen Ressourcen und (ii) danach, wie effizient diese eingesetzt werden. Die Nachhaltigkeitsbewertungen von Ländern stellen ein ergänzendes Instrument der finanziellen Analyse ihrer Kreditratings dar.

Folgende Ausschlusskriterien (mit Umsatzschwellen) wurden im Berichtszeitraum auf das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Waffenarten, die angesichts ihrer langfristigen humanitären Folgen und/oder der großen Anzahl ziviler Opfer bei ihrem Einsatz als umstritten

eingestuft werden. Dazu zählen u. a. biologische, chemische und atomare Waffen, Streumunition und Anti-Personenminen (Umsatzschwelle: 0%);

- Verteidigung und Rüstung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und wesentliche Bauteile) sowie Hilfssysteme und Dienstleistungen im Zusammenhang mit Waffen (Waffeneinsatzsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5%);

- Kohle: Unternehmen, die in erheblichem Umfang im Kohlegeschäft tätig sind und zugleich keine solide Strategie für den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft vorweisen können (Umsatzschwelle: 5% für den Kohlebergbau, 10% für die Kohleverstromung sowie 10% für die Summe aus beiden Komponenten);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen zwecks landwirtschaftlicher Nutzung gentechnisch verändern (Umsatzschwelle: 0%);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0%);

- Tabak: Hersteller von Tabakprodukten (Umsatzschwelle: 5%);

- Erwachsenenunterhaltung: Produzenten von Erwachsenenunterhaltung (Umsatzschwelle: 5%);

- Verstöße gegen Menschenrechte und sonstige Prinzipien des Global Compact: Unternehmen, die nach Maßgabe anerkannter internationaler Standards an schweren Verstößen gegen Menschenrechte oder sonstige Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen beteiligt sind (Umsatzschwelle: 0%).

- Palmöl: Unternehmen mit einem Bezug zu Palmöl ohne ausreichende Zertifizierung durch den Roundtable on Sustainable Palm Oil („RSPO“) werden ausgeschlossen (Umsatzschwelle: 5% für Palmölproduzenten, wenn weniger als 75% der Standorte eine RSPO-Zertifizierung besitzen).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Zeitpunkt dar. Bei nachhaltigen Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem sozialen Ziel beitragen, wird davon ausgegangen, dass sie zu beiden gleichermaßen beitragen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● *Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?*

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	93
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	7

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators (J-1)
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	93	91
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	7	9

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der CO₂-Emissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren Zielen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) in Einklang stehen, oder durch die Einnahme einer Spitzenposition im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren innerhalb der Vergleichsgruppe.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Prüfung auf erhebliche Beeinträchtigungen (Do no significant harm, „DSNH“) schließt Emittenten aus, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellenwerte der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen nicht erreichen. Ein Emittent besteht die Prüfung, wenn er nach der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Bewertung A oder B erhält. Wenn der Emittent im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist, muss er außerdem über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügen, um die Prüfung zu bestehen. Zu den Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen gehören Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie Kraftwerks- und Koks Kohle.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen nach Maßgabe der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen im Rahmen des Investitionsprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten negativen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Investitionen erreicht, die die ökologischen oder sozialen Mindestschwellenwerte nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Mitwirkungsmaßnahmen dienen der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Die Definition des ESG-Auswahlverfahrens und Anlageuniversums beruht auf den

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Richtlinien und der Strategie von JSS für nachhaltiges Investieren, in denen die Prinzipien mehrerer internationaler Übereinkommen und Normen enthalten sind, u. a.:

Die Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen,

Die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

Der Global Compact der Vereinten Nationen,

Die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

Die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

Die Grundsätze zu Kinderrechten und unternehmerischem Handeln,

Die Arbeitsstandards der ILO,

Die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

Das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

Das Übereinkommen über Streumunition.

Der ESG-Auswahlprozess trägt dazu bei, börsennotierte Unternehmen zu ermitteln, die vermeintlich gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung verstoßen, wie in den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte vorgesehen. Diese Unternehmen werden als unvereinbar mit den o. a. Prinzipien erachtet und aus dem Universum nachhaltiger Investitionen von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Unternehmen

THG-Emissionen, CO₂-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind, Anteil des Verbrauchs und der Erzeugung von nicht erneuerbaren Energien, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (berücksichtigt für Ausschlüsse, Klimaversprechen und innerhalb der Nachhaltigkeitsmatrix)

Die schädlichsten Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe werden ausgeschlossen. Seit dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Umsätze aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 10\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 10\%$ aus einer Kombination aus dem Kraftwerkskohlebergbau und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

In Sektoren, in denen CO₂-Emissionen einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine CO₂-Emissionen. Dies umfasst eine Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Senkung der Emissionsintensität seines Kerngeschäfts, zur Senkung seines künftigen Energieverbrauchs oder seiner Treibhausgasemissionen (Scope 1, 2 und 3).

In Sektoren, in denen Möglichkeiten im Bereich der erneuerbaren Energien einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf erneuerbare Energien. Hierzu zählt auch die Bewertung der Kapazität eines Unternehmens im Bereich der erneuerbaren Energien.

Im Mai 2020 hat JSS ein Klimaversprechen abgegeben, das auf Klimaneutralität bis zum Jahr 2035 abzielt. Bei Fonds, bei denen dieses Versprechen bereits umgesetzt wurde, werden Treibhausgasemissionen anhand des CO₂-Fußabdrucks überwacht; diese Kontrollen werden für eine Teilmenge der Fonds durchgeführt. Die Einhaltung des Klimaversprechens wird mithilfe rückwärtsgerichteter Dekarbonisierungspfade überprüft, mit denen Übergangsrisiken gemindert werden sollen. Die meisten Fonds, die das Klimaversprechen umgesetzt haben, wenden folgende Methode an: Das ursprüngliche Ziel entspricht einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen des Referenzwerts um 30%. Diese Zielvorgabe wird in den folgenden Jahren um 7% verringert. Ab 2030 wird das Ziel linear gesenkt, bis das Netto-Null-Ziel im Jahr 2035 schließlich erreicht wird. Die THG-Emissionen des Portfolios auf der Grundlage der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro Mio. USD des Unternehmenswertes (EVIC) ausgedrückt.

Tätigkeiten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung wesentliche ESG-Faktoren darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf Biodiversität und Landnutzung. Hierzu zählt auch eine Bewertung der Auswirkungen der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens auf die Biodiversität. Zudem wird Palmöl konsequent ausgeschlossen.

Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Emissionen in Wasser (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Emissionen in Wasser erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Wasserbewirtschaftung. Die Wasserbewirtschaftung umfasst eine Bewertung wassereffizienter Produktionsprozesse, Trends bei der Wasserintensität sowie messbare, zeitlich befristete Zielvorgaben zur Senkung des Wasserverbrauchs. Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Gefährlicher Abfall (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Schadstoffemissionen und schädlichen Abfällen erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Schadstoffemissionen und seine Abfallwirtschaft. Der Umgang mit Schadstoffemissionen umfasst eine Bewertung der Bemühungen zur Kontrolle und Verringerung der Menge giftiger und krebserregender Nebenprodukte im Rahmen der Geschäftstätigkeit, Trends bei der Schadstofffreisetzung sowie messbare, zeitlich begrenzte Zielvorgaben zur Reduzierung von Schadstoffemissionen.

Verstöße gegen UNGC-Grundsätze (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Fehlende Prozesse zur Überwachung der Einhaltung des UNGC

Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Bestandteil der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Investitionsprozess einbeziehen, sobald die Offenlegungsquoten ausreichend

sind. In der Zwischenzeit erfolgt eine ESG-Überwachung, bei der unter anderem regelmäßige Screenings auf Verstöße gegen die UNGC-Vorgaben durchgeführt werden. JSS strebt eine Berücksichtigung dieses Indikators an, sobald sich die Datenzuverlässigkeit und -verfügbarkeit verbessern.

Engagement in umstrittenen Waffen (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS wird seiner Verantwortung in Bezug auf umstrittene Waffen aktiv gerecht, indem es sie konzernweit ausschließt. JSS investiert keine Eigenmittel in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich der umstrittenen Waffen tätig sind. Ferner übernimmt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für solche Unternehmen bzw. keine Dienstleistungen im Zusammenhang mit Kapitalmärkten oder Fusionen und Übernahmen.

Staaten

THG-Emissionsintensität (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die externen Umweltkosten eines Landes. Bewertet werden unter anderem die Treibhausgasemissionen pro Kopf.

Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Landes in Bezug auf Grundrechte.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 – 30.06.2024

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
AMAZON.COM INC	Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	6,44	US
ALPHABET INC-CL A	Information und Kommunikation	5,89	US
MICROSOFT CORP	Information und Kommunikation	5,85	US
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,26	TW
NVIDIA CORP	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,75	US
CME GROUP INC	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	3,53	US
ASML HOLDING NV	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,32	NL
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	3,23	GB
OTIS WORLDWIDE CORP	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,22	US
ZOETIS INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,21	US
COMPASS GROUP PLC	Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	2,93	GB
ENTEGRIS INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,87	US
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,62	US

Hauptinvestitionen per 30.06.2024 (Ende des Geschäftsjahres). Keine bedeutenden Abweichungen über das Geschäftsjahr.

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

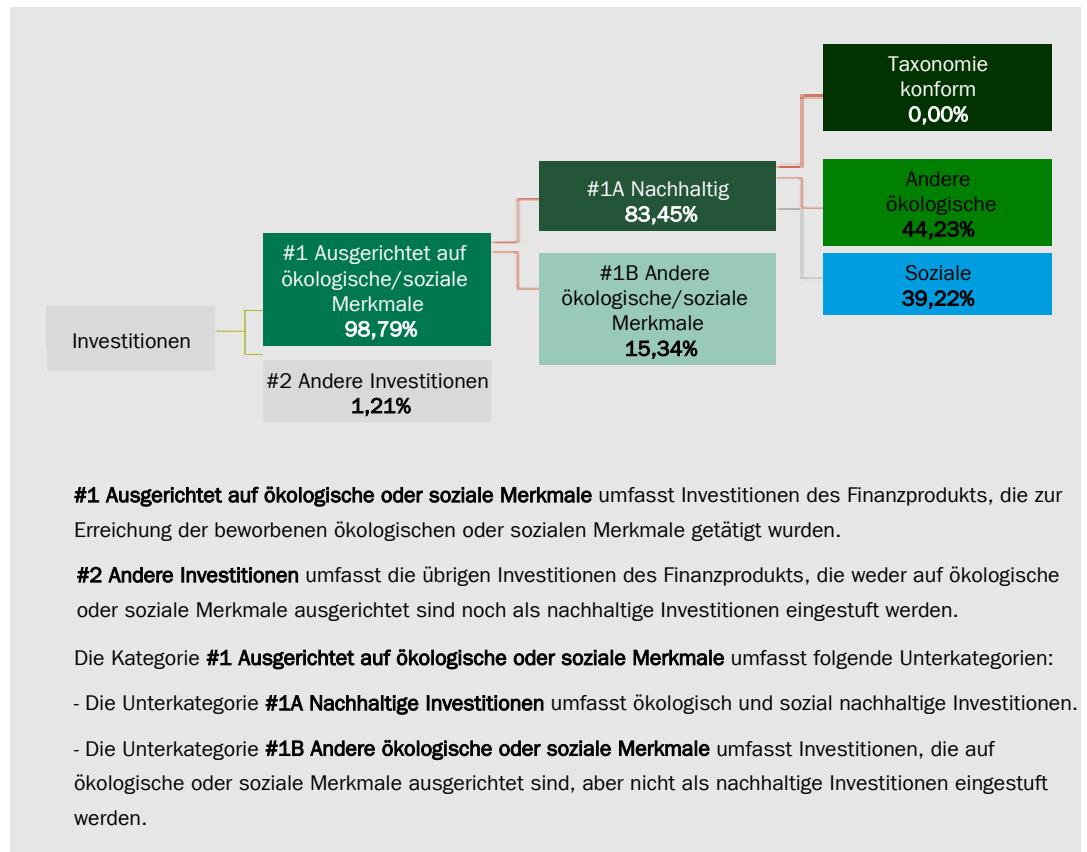


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 83,45%. 44,23% der Investitionen des Finanzprodukts waren ökologisch nachhaltige Investitionen, und 39,22% der Investitionen des Finanzprodukts waren sozial nachhaltige Investitionen. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Bezeichnung des Sektors	Anteil der Investitionen
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von elektronischen Bauelementen	8,01%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	7,88%
Information und Kommunikation – Webportale	7,27%
Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Effekten- und Warenbörsen	6,76%
Handel mit Kraftfahrzeugen; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen – Versand- und Internet-Einzelhandel	6,44%
Information und Kommunikation – Verlegen von sonstiger Software	5,85%
Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen – Einzelhandel (ohne Handel mit Kraftfahrzeugen)	4,71%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Bestrahlungs- und Elektrotherapiegeräten und elektromedizinischen Geräten	4,55%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von pharmazeutischen Erzeugnissen	4,09%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Maschinen für sonstige bestimmte Wirtschaftszweige a. n. g.	3,32%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Hebezeugen und Fördermitteln	3,22%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von pharmazeutischen Erzeugnissen	3,21%
Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie – Gastronomie	2,93%
Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden – Gewinnung von Erdöl und Erdgas	2,58%
Information und Kommunikation – Informationsdienstleistungen	2,42%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von sonstigen chemischen Erzeugnissen a. n. g.	2,32%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Seifen, Wasch- und Reinigungsmitteln	2,20%
Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen – Architektur- und Ingenieurbüros	2,19%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Verbrennungsmotoren und Turbinen (ohne Motoren für Luft- und Straßenfahrzeuge)	2,15%
Andere	17,90%

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** enthalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend; dieses Finanzprodukt hat sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel verpflichtet, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert(1)?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

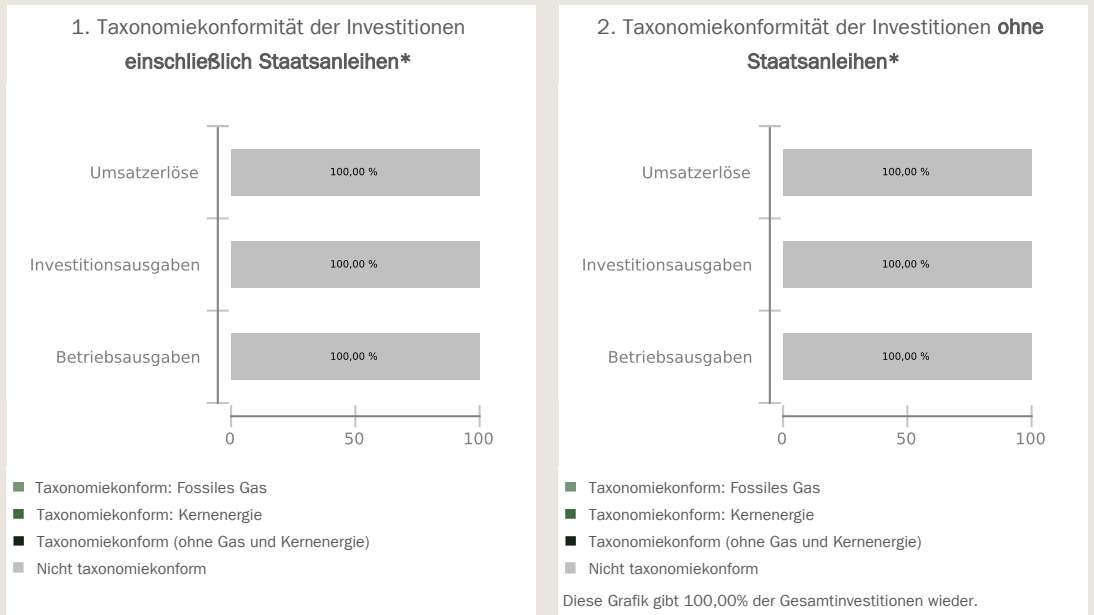
Nein

(1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind: 0,00%

Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind: 0,00%

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen	Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen (J-1)
0,00%	0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden: 44,23%

Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein; allerdings ist der Anlageverwalter gegenwärtig nicht in der Lage, den Anteil der zugrundeliegenden Investitionen des Finanzprodukts, berechnet gemäß der EU-Taxonomie, genau anzugeben. Diese Position wird jedoch weiterhin geprüft, während die zugrundeliegenden Regelungen im Laufe der Zeit fertiggestellt und mehr zuverlässige Daten verfügbar werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen: 39,22%



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts folgte einem rigorosen Verfahren, bei dem durchgängig ESG-Aspekte berücksichtigt wurden. Der Anlageverwalter wendete bei seiner Strategie die folgenden verbindlichen Kriterien an:

(a) Ausschluss von Anlagen in umstrittenen Geschäftsaktivitäten gemäß den Ausschlussrichtlinien von JSS;

(b) Erreichung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte nicht in mit C oder D bewertete Emittenten.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Name des Produkts: JSS Investmentfonds SICAV – JSS Sustainable Bond – Global Short-term
 Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300RNF CXJV1C4M46

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 37,64% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt integriert umweltbezogene, soziale und die Unternehmensführung betreffende Aspekte („ESG“) in den Investitionsprozess mit dem Ziel, ein überdurchschnittlich gutes ESG-Profil für das gesamte Portfolio gemäß der von J. Safra Sarasin („JSS“) entwickelten Nachhaltigkeitsmatrix zu erreichen.

Das ESG-Rating von JSS bewertet die Emittenten im Verhältnis zu ihrer Vergleichsgruppe und reicht von A für Emittenten, die in die Spitzenklasse eingestuft werden, bis zu D für Emittenten, die ggf. eine umstrittene Geschäftstätigkeit ausüben. Beim nachhaltigen Investieren werden Emittenten, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und bei denen die Wahrscheinlichkeit für erhebliche Beeinträchtigungen daher erhöht ist, mit C (schlechteste Leistung im Branchenvergleich) oder D (wegen umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse von Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, die Kreditratings von Staaten unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien zu analysieren. JSS misst die nachhaltige Wirtschaftsleistung eines Landes nach (i) der Verfügbarkeit von natürlichen Ressourcen und (ii) danach, wie effizient diese eingesetzt werden. Die Nachhaltigkeitsbewertungen von Ländern stellen ein ergänzendes Instrument der finanziellen Analyse ihrer Kreditratings dar.

Folgende Ausschlusskriterien (mit Umsatzschwellen) wurden im Berichtszeitraum auf das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Waffenarten, die angesichts ihrer langfristigen humanitären Folgen und/oder der großen Anzahl ziviler Opfer bei ihrem Einsatz als umstritten

eingestuft werden. Dazu zählen u. a. biologische, chemische und atomare Waffen, Streumunition und Anti-Personenminen (Umsatzschwelle: 0%);

- Verteidigung und Rüstung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und wesentliche Bauteile) sowie Hilfssysteme und Dienstleistungen im Zusammenhang mit Waffen (Waffeneinsatzsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5%);

- Kohle: Unternehmen, die in erheblichem Umfang im Kohlegeschäft tätig sind und zugleich keine solide Strategie für den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft vorweisen können (Umsatzschwelle: 5% für den Kohlebergbau, 10% für die Kohleverstromung sowie 10% für die Summe aus beiden Komponenten);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen zwecks landwirtschaftlicher Nutzung gentechnisch verändern (Umsatzschwelle: 0%);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0%);

- Tabak: Hersteller von Tabakprodukten (Umsatzschwelle: 5%);

- Erwachsenenunterhaltung: Produzenten von Erwachsenenunterhaltung (Umsatzschwelle: 5%);

- Verstöße gegen Menschenrechte und sonstige Prinzipien des Global Compact: Unternehmen, die nach Maßgabe anerkannter internationaler Standards an schweren Verstößen gegen Menschenrechte oder sonstige Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen beteiligt sind (Umsatzschwelle: 0%).

- Palmöl: Unternehmen mit einem Bezug zu Palmöl ohne ausreichende Zertifizierung durch den Roundtable on Sustainable Palm Oil („RSPO“) werden ausgeschlossen (Umsatzschwelle: 5% für Palmölproduzenten, wenn weniger als 75% der Standorte eine RSPO-Zertifizierung besitzen).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Zeitpunkt dar. Bei nachhaltigen Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem sozialen Ziel beitragen, wird davon ausgegangen, dass sie zu beiden gleichermaßen beitragen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● *Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?*

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	43
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	52

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators (J-1)
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	43	44
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	52	46

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der CO₂-Emissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren Zielen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) in Einklang stehen, oder durch die Einnahme einer Spitzenposition im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren innerhalb der Vergleichsgruppe.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Prüfung auf erhebliche Beeinträchtigungen (Do no significant harm, „DSNH“) schließt Emittenten aus, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellenwerte der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen nicht erreichen. Ein Emittent besteht die Prüfung, wenn er nach der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Bewertung A oder B erhält. Wenn der Emittent im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist, muss er außerdem über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügen, um die Prüfung zu bestehen. Zu den Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen gehören Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie Kraftwerks- und Koks Kohle.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen nach Maßgabe der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen im Rahmen des Investitionsprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten negativen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Investitionen erreicht, die die ökologischen oder sozialen Mindestschwellenwerte nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Mitwirkungsmaßnahmen dienen der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Die Definition des ESG-Auswahlverfahrens und Anlageuniversums beruht auf den

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Richtlinien und der Strategie von JSS für nachhaltiges Investieren, in denen die Prinzipien mehrerer internationaler Übereinkommen und Normen enthalten sind, u. a.:

Die Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen,

Die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

Der Global Compact der Vereinten Nationen,

Die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

Die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

Die Grundsätze zu Kinderrechten und unternehmerischem Handeln,

Die Arbeitsstandards der ILO,

Die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

Das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

Das Übereinkommen über Streumunition.

Der ESG-Auswahlprozess trägt dazu bei, börsennotierte Unternehmen zu ermitteln, die vermeintlich gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung verstoßen, wie in den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte vorgesehen. Diese Unternehmen werden als unvereinbar mit den o. a. Prinzipien erachtet und aus dem Universum nachhaltiger Investitionen von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Unternehmen

THG-Emissionen, CO₂-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind, Anteil des Verbrauchs und der Erzeugung von nicht erneuerbaren Energien, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (berücksichtigt für Ausschlüsse, Klimaversprechen und innerhalb der Nachhaltigkeitsmatrix)

Die schädlichsten Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe werden ausgeschlossen. Seit dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Umsätze aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 10\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 10\%$ aus einer Kombination aus dem Kraftwerkskohlebergbau und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

In Sektoren, in denen CO₂-Emissionen einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine CO₂-Emissionen. Dies umfasst eine Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Senkung der Emissionsintensität seines Kerngeschäfts, zur Senkung seines künftigen Energieverbrauchs oder seiner Treibhausgasemissionen (Scope 1, 2 und 3).

In Sektoren, in denen Möglichkeiten im Bereich der erneuerbaren Energien einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf erneuerbare Energien. Hierzu zählt auch die Bewertung der Kapazität eines Unternehmens im Bereich der erneuerbaren Energien.

Im Mai 2020 hat JSS ein Klimaversprechen abgegeben, das auf Klimaneutralität bis zum Jahr 2035 abzielt. Bei Fonds, bei denen dieses Versprechen bereits umgesetzt wurde, werden Treibhausgasemissionen anhand des CO₂-Fußabdrucks überwacht; diese Kontrollen werden für eine Teilmenge der Fonds durchgeführt. Die Einhaltung des Klimaversprechens wird mithilfe rückwärtsgerichteter Dekarbonisierungspfade überprüft, mit denen Übergangsrisiken gemindert werden sollen. Die meisten Fonds, die das Klimaversprechen umgesetzt haben, wenden folgende Methode an: Das ursprüngliche Ziel entspricht einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen des Referenzwerts um 30%. Diese Zielvorgabe wird in den folgenden Jahren um 7% verringert. Ab 2030 wird das Ziel linear gesenkt, bis das Netto-Null-Ziel im Jahr 2035 schließlich erreicht wird. Die THG-Emissionen des Portfolios auf der Grundlage der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro Mio. USD des Unternehmenswertes (EVIC) ausgedrückt.

Tätigkeiten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung wesentliche ESG-Faktoren darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf Biodiversität und Landnutzung. Hierzu zählt auch eine Bewertung der Auswirkungen der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens auf die Biodiversität. Zudem wird Palmöl konsequent ausgeschlossen.

Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Emissionen in Wasser (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Emissionen in Wasser erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Wasserbewirtschaftung. Die Wasserbewirtschaftung umfasst eine Bewertung wassereffizienter Produktionsprozesse, Trends bei der Wasserintensität sowie messbare, zeitlich befristete Zielvorgaben zur Senkung des Wasserverbrauchs. Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Gefährlicher Abfall (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Schadstoffemissionen und schädlichen Abfällen erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Schadstoffemissionen und seine Abfallwirtschaft. Der Umgang mit Schadstoffemissionen umfasst eine Bewertung der Bemühungen zur Kontrolle und Verringerung der Menge giftiger und krebserregender Nebenprodukte im Rahmen der Geschäftstätigkeit, Trends bei der Schadstofffreisetzung sowie messbare, zeitlich begrenzte Zielvorgaben zur Reduzierung von Schadstoffemissionen.

Verstöße gegen UNGC-Grundsätze (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Fehlende Prozesse zur Überwachung der Einhaltung des UNGC

Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Bestandteil der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Investitionsprozess einbeziehen, sobald die Offenlegungsquoten ausreichend

sind. In der Zwischenzeit erfolgt eine ESG-Überwachung, bei der unter anderem regelmäßige Screenings auf Verstöße gegen die UNGC-Vorgaben durchgeführt werden. JSS strebt eine Berücksichtigung dieses Indikators an, sobald sich die Datenzuverlässigkeit und -verfügbarkeit verbessern.

Engagement in umstrittenen Waffen (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS wird seiner Verantwortung in Bezug auf umstrittene Waffen aktiv gerecht, indem es sie konzernweit ausschließt. JSS investiert keine Eigenmittel in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich der umstrittenen Waffen tätig sind. Ferner übernimmt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für solche Unternehmen bzw. keine Dienstleistungen im Zusammenhang mit Kapitalmärkten oder Fusionen und Übernahmen.

Staaten

THG-Emissionsintensität (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die externen Umweltkosten eines Landes. Bewertet werden unter anderem die Treibhausgasemissionen pro Kopf.

Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Landes in Bezug auf Grundrechte.



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 – 30.06.2024

Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
STANDARD CHARTERED PLC	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,71	GB
HANA BANK	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,67	KR
PROSUS NV	Information und Kommunikation	1,65	NL
INVERSIONES CMPC SA	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,55	CL
CELULOSA ARAUCO CONSTITU	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,44	CL
STANDARD CHARTERED PLC	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,44	GB
BANCO SANTANDER MEXICO	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,43	MX
US TREASURY N/B	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	1,43	US
REC LTD	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,35	IN
MISC CAPITAL TWO LABUAN	Verkehr und Lagerei	1,17	MY
BANCO BILBAO VIZCAYA ARG	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,15	ES
SLOVENSKA SPORITELNA AS	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,08	SK
ICICI BANK LTD/DUBAI	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,07	IN
OTP BANK NYRT	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,04	HU
RAIFFEISENBANK AS	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,02	CZ

Hauptinvestitionen per 30.06.2024 (Ende des Geschäftsjahres). Keine bedeutenden Abweichungen über das Geschäftsjahr.

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Die Gewichtung von Anleihen wird ermittelt, indem der Marktpreis der Anleihe (einschließlich aufgelaufener Zinsen) durch das Gesamtvermögen des Teilfonds geteilt wird.



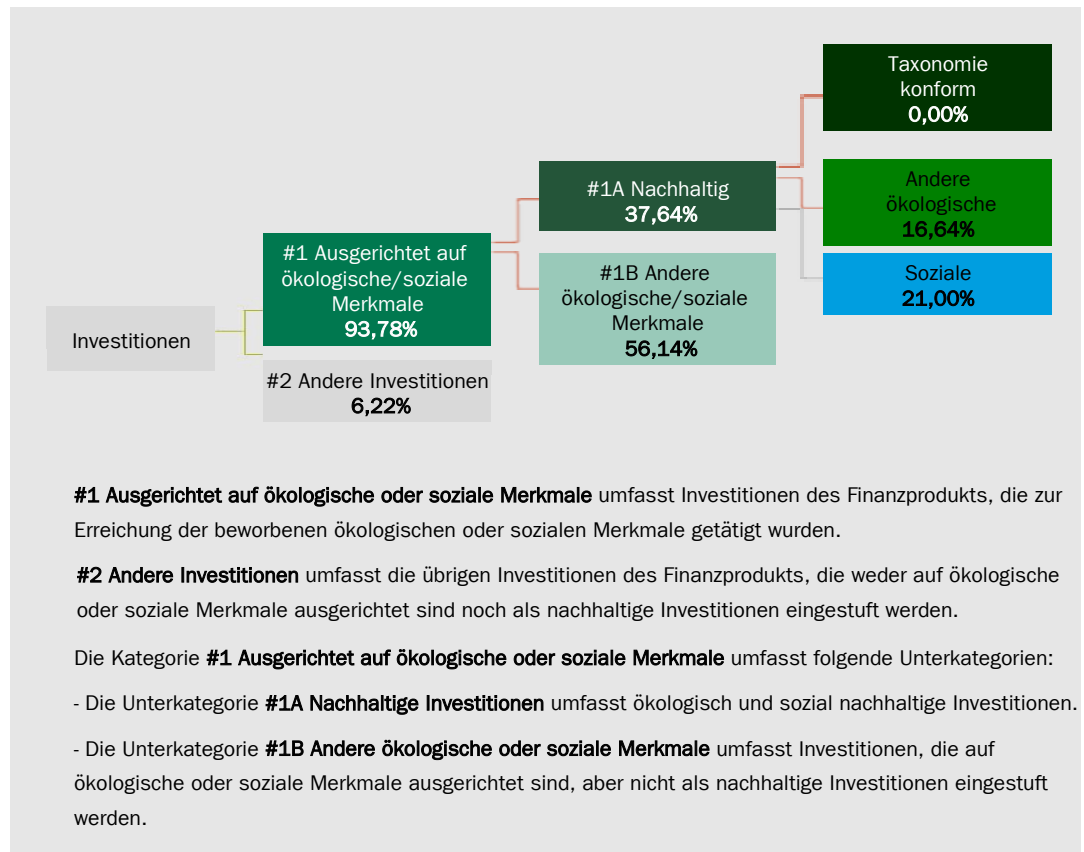
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 37,64%.

16,64% der Investitionen des Finanzprodukts waren ökologisch nachhaltige Investitionen, und 21% der Investitionen des Finanzprodukts waren sozial nachhaltige Investitionen. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Bezeichnung des Sektors	Anteil der Investitionen
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Sonstige Kreditinstitute (ohne Spezialkreditinstitute)	30,40%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Beteiligungsgesellschaften	8,12%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Zentralbanken	7,11%
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung – Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	4,71%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Institutionen für Finanzierungsleasing	4,58%
Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen – Einzelhandel (ohne Handel mit Kraftfahrzeugen)	4,20%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Papier, Pappe und Waren daraus	3,14%
Energieversorgung – Elektrizitäts-, Gas-, Wärme- und Kälteversorgung	2,57%
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung – Allgemeine öffentliche Verwaltung	2,20%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	2,15%
Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden – Gewinnung von Erdöl und Erdgas	2,10%
Verkehr und Lagerei – Verkehr und Lagerei	1,79%
Information und Kommunikation – Rundfunkveranstalter	1,65%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,62%
Kunst, Unterhaltung und Erholung – Erbringung von Dienstleistungen des Sports, der Unterhaltung und der Erholung	1,56%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von chemischen Erzeugnissen	1,48%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Nahrungs- und Futtermitteln	1,36%
Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Grundstücks- und Wohnungswesen	1,27%
Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen – Erbringung sonstiger wirtschaftlicher Dienstleistungen für Unternehmen und Privatpersonen a. n. g.	1,17%
Andere	16,82%

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** enthalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend; dieses Finanzprodukt hat sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel verpflichtet, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert(1)?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

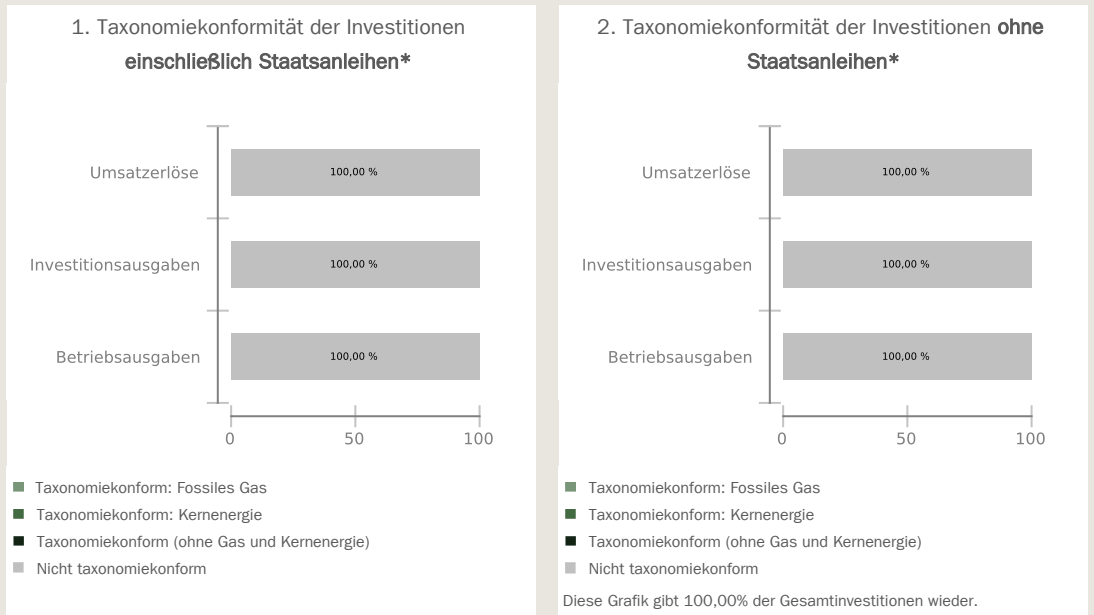
Nein

(1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind: 0,00%

Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind: 0,00%

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen	Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen (J-1)
0,00%	0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden: 16,64%

Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein; allerdings ist der Anlageverwalter gegenwärtig nicht in der Lage, den Anteil der zugrundeliegenden Investitionen des Finanzprodukts, berechnet gemäß der EU-Taxonomie, genau anzugeben. Diese Position wird jedoch weiterhin geprüft, während die zugrundeliegenden Regelungen im Laufe der Zeit fertiggestellt und mehr zuverlässige Daten verfügbar werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen: 21,00%



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts folgte einem rigorosen Verfahren, bei dem durchgängig ESG-Aspekte berücksichtigt wurden. Der Anlageverwalter wendete bei seiner Strategie die folgenden verbindlichen Kriterien an:

(a) Ausschluss von Anlagen in umstrittenen Geschäftsaktivitäten gemäß den Ausschlussrichtlinien von JSS;

(b) Erreichung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte nicht in mit C oder D bewertete Emittenten.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Name des Produkts: JSS Investmentfonds SICAV – JSS Sustainable Bond CHF
 Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300EPS53HD80G4G84

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja		Nein	
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 75,42% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/>		<input type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt integriert umweltbezogene, soziale und die Unternehmensführung betreffende Aspekte („ESG“) in den Investitionsprozess mit dem Ziel, ein überdurchschnittlich gutes ESG-Profil für das gesamte Portfolio gemäß der von J. Safra Sarasin („JSS“) entwickelten Nachhaltigkeitsmatrix zu erreichen.

Das ESG-Rating von JSS bewertet die Emittenten im Verhältnis zu ihrer Vergleichsgruppe und reicht von A für Emittenten, die in die Spitzenklasse eingestuft werden, bis zu D für Emittenten, die ggf. eine umstrittene Geschäftstätigkeit ausüben. Beim nachhaltigen Investieren werden Emittenten, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und bei denen die Wahrscheinlichkeit für erhebliche Beeinträchtigungen daher erhöht ist, mit C (schlechteste Leistung im Branchenvergleich) oder D (wegen umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse von Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, die Kreditratings von Staaten unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien zu analysieren. JSS misst die nachhaltige Wirtschaftsleistung eines Landes nach (i) der Verfügbarkeit von natürlichen Ressourcen und (ii) danach, wie effizient diese eingesetzt werden. Die Nachhaltigkeitsbewertungen von Ländern stellen ein ergänzendes Instrument der finanziellen Analyse ihrer Kreditratings dar.

Folgende Ausschlusskriterien (mit Umsatzschwellen) wurden im Berichtszeitraum auf das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Waffenarten, die angesichts ihrer langfristigen humanitären Folgen und/oder der großen Anzahl ziviler Opfer bei ihrem Einsatz als umstritten

eingestuft werden. Dazu zählen u. a. biologische, chemische und atomare Waffen, Streumunition und Anti-Personenminen (Umsatzschwelle: 0%);

- Verteidigung und Rüstung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und wesentliche Bauteile) sowie Hilfssysteme und Dienstleistungen im Zusammenhang mit Waffen (Waffeneinsatzsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5%);

- Kohle: Unternehmen, die in erheblichem Umfang im Kohlegeschäft tätig sind und zugleich keine solide Strategie für den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft vorweisen können (Umsatzschwelle: 5% für den Kohlebergbau, 10% für die Kohleverstromung sowie 10% für die Summe aus beiden Komponenten);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen zwecks landwirtschaftlicher Nutzung gentechnisch verändern (Umsatzschwelle: 0%);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0%);

- Tabak: Hersteller von Tabakprodukten (Umsatzschwelle: 5%);

- Erwachsenenunterhaltung: Produzenten von Erwachsenenunterhaltung (Umsatzschwelle: 5%);

- Verstöße gegen Menschenrechte und sonstige Prinzipien des Global Compact: Unternehmen, die nach Maßgabe anerkannter internationaler Standards an schweren Verstößen gegen Menschenrechte oder sonstige Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen beteiligt sind (Umsatzschwelle: 0%).

- Palmöl: Unternehmen mit einem Bezug zu Palmöl ohne ausreichende Zertifizierung durch den Roundtable on Sustainable Palm Oil („RSPO“) werden ausgeschlossen (Umsatzschwelle: 5% für Palmölproduzenten, wenn weniger als 75% der Standorte eine RSPO-Zertifizierung besitzen).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Zeitpunkt dar. Bei nachhaltigen Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem sozialen Ziel beitragen, wird davon ausgegangen, dass sie zu beiden gleichermaßen beitragen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● *Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?*

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	81
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	19

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators (J-1)
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	81	91
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	19	9

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der CO₂-Emissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren Zielen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) in Einklang stehen, oder durch die Einnahme einer Spitzenposition im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren innerhalb der Vergleichsgruppe.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Prüfung auf erhebliche Beeinträchtigungen (Do no significant harm, „DSNH“) schließt Emittenten aus, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellenwerte der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen nicht erreichen. Ein Emittent besteht die Prüfung, wenn er nach der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Bewertung A oder B erhält. Wenn der Emittent im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist, muss er außerdem über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügen, um die Prüfung zu bestehen. Zu den Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen gehören Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie Kraftwerks- und Koks Kohle.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen nach Maßgabe der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen im Rahmen des Investitionsprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten negativen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Investitionen erreicht, die die ökologischen oder sozialen Mindestschwellenwerte nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Mitwirkungsmaßnahmen dienen der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Die Definition des ESG-Auswahlverfahrens und Anlageuniversums beruht auf den

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Richtlinien und der Strategie von JSS für nachhaltiges Investieren, in denen die Prinzipien mehrerer internationaler Übereinkommen und Normen enthalten sind, u. a.:

Die Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen,

Die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

Der Global Compact der Vereinten Nationen,

Die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

Die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

Die Grundsätze zu Kinderrechten und unternehmerischem Handeln,

Die Arbeitsstandards der ILO,

Die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

Das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

Das Übereinkommen über Streumunition.

Der ESG-Auswahlprozess trägt dazu bei, börsennotierte Unternehmen zu ermitteln, die vermeintlich gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung verstoßen, wie in den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte vorgesehen. Diese Unternehmen werden als unvereinbar mit den o. a. Prinzipien erachtet und aus dem Universum nachhaltiger Investitionen von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Unternehmen

THG-Emissionen, CO₂-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind, Anteil des Verbrauchs und der Erzeugung von nicht erneuerbaren Energien, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (berücksichtigt für Ausschlüsse, Klimaversprechen und innerhalb der Nachhaltigkeitsmatrix)

Die schädlichsten Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe werden ausgeschlossen. Seit dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Umsätze aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 10\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 10\%$ aus einer Kombination aus dem Kraftwerkskohlebergbau und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

In Sektoren, in denen CO₂-Emissionen einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine CO₂-Emissionen. Dies umfasst eine Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Senkung der Emissionsintensität seines Kerngeschäfts, zur Senkung seines künftigen Energieverbrauchs oder seiner Treibhausgasemissionen (Scope 1, 2 und 3).

In Sektoren, in denen Möglichkeiten im Bereich der erneuerbaren Energien einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf erneuerbare Energien. Hierzu zählt auch die Bewertung der Kapazität eines Unternehmens im Bereich der erneuerbaren Energien.

Im Mai 2020 hat JSS ein Klimaversprechen abgegeben, das auf Klimaneutralität bis zum Jahr 2035 abzielt. Bei Fonds, bei denen dieses Versprechen bereits umgesetzt wurde, werden Treibhausgasemissionen anhand des CO₂-Fußabdrucks überwacht; diese Kontrollen werden für eine Teilmenge der Fonds durchgeführt. Die Einhaltung des Klimaversprechens wird mithilfe rückwärtsgerichteter Dekarbonisierungspfade überprüft, mit denen Übergangsrisiken gemindert werden sollen. Die meisten Fonds, die das Klimaversprechen umgesetzt haben, wenden folgende Methode an: Das ursprüngliche Ziel entspricht einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen des Referenzwerts um 30%. Diese Zielvorgabe wird in den folgenden Jahren um 7% verringert. Ab 2030 wird das Ziel linear gesenkt, bis das Netto-Null-Ziel im Jahr 2035 schließlich erreicht wird. Die THG-Emissionen des Portfolios auf der Grundlage der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro Mio. USD des Unternehmenswertes (EVIC) ausgedrückt.

Tätigkeiten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung wesentliche ESG-Faktoren darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf Biodiversität und Landnutzung. Hierzu zählt auch eine Bewertung der Auswirkungen der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens auf die Biodiversität. Zudem wird Palmöl konsequent ausgeschlossen.

Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Emissionen in Wasser (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Emissionen in Wasser erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Wasserbewirtschaftung. Die Wasserbewirtschaftung umfasst eine Bewertung wassereffizienter Produktionsprozesse, Trends bei der Wasserintensität sowie messbare, zeitlich befristete Zielvorgaben zur Senkung des Wasserverbrauchs. Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Gefährlicher Abfall (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Schadstoffemissionen und schädlichen Abfällen erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Schadstoffemissionen und seine Abfallwirtschaft. Der Umgang mit Schadstoffemissionen umfasst eine Bewertung der Bemühungen zur Kontrolle und Verringerung der Menge giftiger und krebserregender Nebenprodukte im Rahmen der Geschäftstätigkeit, Trends bei der Schadstofffreisetzung sowie messbare, zeitlich begrenzte Zielvorgaben zur Reduzierung von Schadstoffemissionen.

Verstöße gegen UNGC-Grundsätze (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Fehlende Prozesse zur Überwachung der Einhaltung des UNGC

Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Bestandteil der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Investitionsprozess einbeziehen, sobald die Offenlegungsquoten ausreichend

sind. In der Zwischenzeit erfolgt eine ESG-Überwachung, bei der unter anderem regelmäßige Screenings auf Verstöße gegen die UNGC-Vorgaben durchgeführt werden. JSS strebt eine Berücksichtigung dieses Indikators an, sobald sich die Datenzuverlässigkeit und -verfügbarkeit verbessern.

Engagement in umstrittenen Waffen (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS wird seiner Verantwortung in Bezug auf umstrittene Waffen aktiv gerecht, indem es sie konzernweit ausschließt. JSS investiert keine Eigenmittel in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich der umstrittenen Waffen tätig sind. Ferner übernimmt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für solche Unternehmen bzw. keine Dienstleistungen im Zusammenhang mit Kapitalmärkten oder Fusionen und Übernahmen.

Staaten

THG-Emissionsintensität (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die externen Umweltkosten eines Landes. Bewertet werden unter anderem die Treibhausgasemissionen pro Kopf.

Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Landes in Bezug auf Grundrechte.



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 – 30.06.2024

Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
CREDIT AGRICOLE SA	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,16	FR
MÜNCHENER HYPOTHEKENBANK	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,92	DE
BANQUE FED CRED MUTUEL	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,59	FR
COMMONWEALTH BANK AUST	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,59	AU
ENEL FINANCE INTL NV	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,53	NL
BANQUE FED CRED MUTUEL	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,53	FR
ADCB FINANCE CAYMAN LTD	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,52	KY
CANADIAN IMPERIAL BANK	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,51	CA
SPAREBANK 1 NORD NORGE	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,50	NO
FIRST ABU DHABI BANK PJS	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,50	AE
DEUTSCHE BAHN FIN GMBH	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,49	DE
BANC CREDITO INVERSIONES	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,47	CL
BANCO DEL ESTADO - CHILE	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,47	CL
MACQUARIE GROUP LTD	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,46	AU
BANCO SANTANDER SA	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,46	ES

Hauptinvestitionen per 30.06.2024 (Ende des Geschäftsjahres). Keine bedeutenden Abweichungen über das Geschäftsjahr.

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Die Gewichtung von Anleihen wird ermittelt, indem der Marktpreis der Anleihe (einschließlich aufgelaufener Zinsen) durch das Gesamtvermögen des Teilfonds geteilt wird.



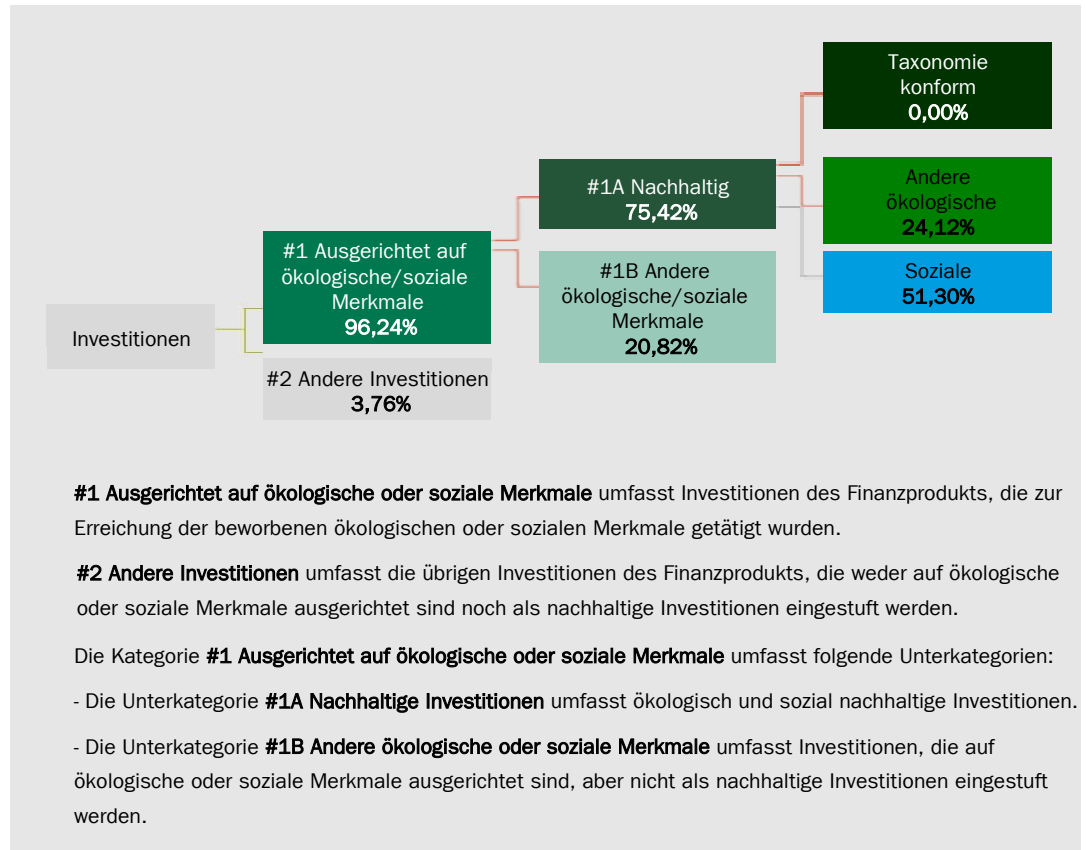
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 75,42%.

24,12% der Investitionen des Finanzprodukts waren ökologisch nachhaltige Investitionen, und 51,3% der Investitionen des Finanzprodukts waren sozial nachhaltige Investitionen. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Bezeichnung des Sektors	Anteil der Investitionen
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Sonstige Kreditinstitute (ohne Spezialkreditinstitute)	52,90%
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung – Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	6,26%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Beteiligungsgesellschaften	5,31%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	5,20%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Lebensversicherungen	3,91%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Fondsmanagement	3,60%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Spezialkreditinstitute	3,16%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Dienstleistungen des Effekten- und Warenhandels	3,15%
Information und Kommunikation – Drahtlose Telekommunikation	3,02%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Zentralbanken	2,51%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Sonstige Finanzdienstleistungen außer Versicherungen und Pensionskassen (nicht anderweitig erfasst)	2,21%
Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung – Öffentliche Verwaltung auf den Gebieten Gesundheitswesen, Bildung, Kultur und Sozialwesen	2,05%
Energieversorgung – Elektrizitätserzeugung	1,09%
Verkehr und Lagerei – Personenbeförderung im Nahverkehr zu Lande	1,05%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Automobilen und Automobilteilen	1,04%
Verkehr und Lagerei – Verkehr und Lagerei	1,03%
Verkehr und Lagerei – Erbringung von sonstigen Dienstleistungen für die Luftfahrt	1,03%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,96%
Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Vermietung, Verpachtung von eigenen oder geleasteten Grundstücken, Gebäuden und Wohnungen	0,52%

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** enthalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend; dieses Finanzprodukt hat sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel verpflichtet, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert(1)?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

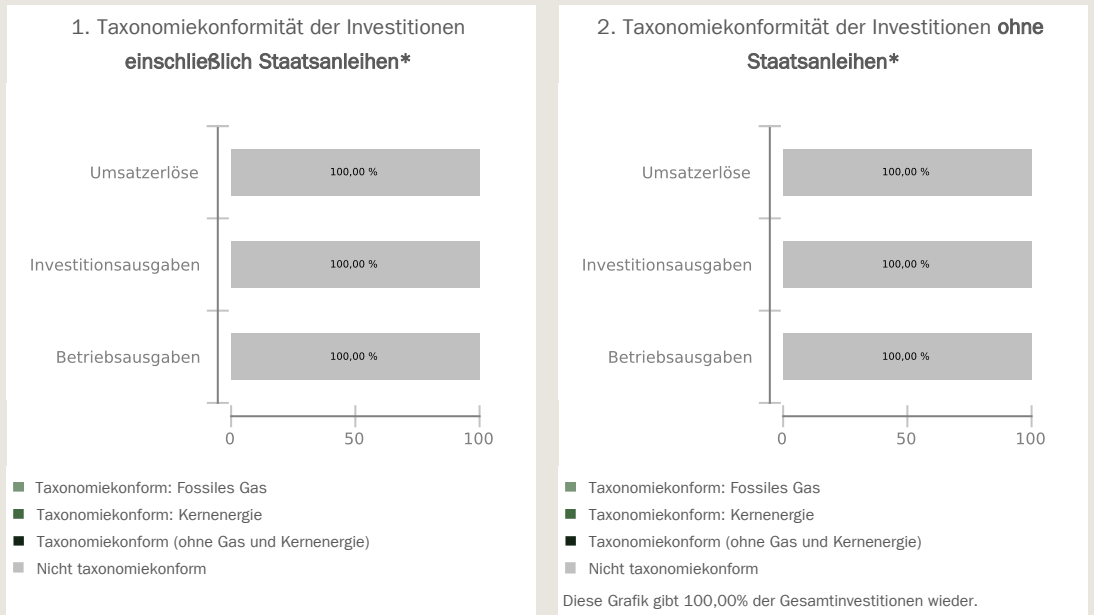
Nein

(1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind: 0,00%

Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind: 0,00%

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen	Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen (J-1)
0,00%	0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden: 24,12%

Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein; allerdings ist der Anlageverwalter gegenwärtig nicht in der Lage, den Anteil der zugrundeliegenden Investitionen des Finanzprodukts, berechnet gemäß der EU-Taxonomie, genau anzugeben. Diese Position wird jedoch weiterhin geprüft, während die zugrundeliegenden Regelungen im Laufe der Zeit fertiggestellt und mehr zuverlässige Daten verfügbar werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen: 51,30%



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts folgte einem rigorosen Verfahren, bei dem durchgängig ESG-Aspekte berücksichtigt wurden. Der Anlageverwalter wendete bei seiner Strategie die folgenden verbindlichen Kriterien an:

- (a) Ausschluss von Anlagen in umstrittenen Geschäftsaktivitäten gemäß den Ausschlussrichtlinien von JSS;
- (b) Erreichung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte nicht in mit C oder D bewertete Emittenten.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Name des Produkts: JSS Investmentfonds SICAV – JSS Sustainable Bond – Euro Broad
 Unternehmenskennung (LEI-Code): 5493000W9WO226KD5J14

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Ja		<input type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="checkbox"/> Nein	
<input checked="" type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : 53,39%	<input type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es __% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input checked="" type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : 44,43%	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/>		<input type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Ziel des Produkts ist es, zur Bekämpfung des Klimawandels beizutragen, um die CO2-Bilanz (Angaben zu den CO2-Emissionen pro investierter Million US-Dollar) im Laufe der Zeit zu verringern, bis entsprechend dem Klimaversprechen von JSS im Jahr 2035 CO2-Neutralität erreicht ist. Darüber hinaus strebte das Produkt für Unternehmensemittenten eine anfängliche CO2-Bilanz an, die mindestens 30% unter der CO2-Bilanz der aktuellen Benchmark liegt. In den folgenden Jahren bis 2030 ist die CO2-Bilanz jährlich um 7% zu reduzieren. Ab 2030 soll die CO2-Bilanz linear reduziert werden, um im Jahr 2035 schließlich netto null zu erreichen. Zu diesem Zweck investierte der Fonds in Anleihen mit Umwelt-, Sozial- und/oder Nachhaltigkeitslabel entsprechend der Definition in Marktstandards, wie den Green Bond, Social Bond, Sustainability Bond und Sustainability-linked Principles, sowie offiziellen Vorschriften wie denen der International Capital Market Association (ICMA) oder der EU-Verordnung über grüne Anleihen. Mit diesen Anleihen werden bestimmte grüne Projekte finanziert oder refinanziert, die sich positiv auf die Umwelt, die Gesellschaft und/oder das Klima auswirken sollen. Das Finanzprodukt zielte darauf ab, zu einer Reihe ökologischer Ziele beizutragen, darunter Bekämpfung des Klimawandels, Anpassung an den Klimawandel, nachhaltige Nutzung und Schutz von Wasser- und Meeresressourcen, Übergang zur Kreislaufwirtschaft, Vermeidung und Verminderung der Umweltverschmutzung sowie Schutz und Wiederherstellung der Biodiversität und der Ökosysteme, wie auch zum sozialen Ziel des gesellschaftlichen Zusammenhalts. Neben den wirkungsorientierten Zielen berücksichtigte der Teilfonds im gesamten Anlageprozess umweltbezogene, soziale und die Unternehmensführung („ESG“) betreffende Aspekte. Ziel war es, zu gewährleisten, dass nachhaltige Investitionen nachhaltigkeitsbezogene Anlageziele nicht erheblich beeinträchtigen, umstrittene Engagements zu verringern, das Portfolio an internationale Normen anzupassen und gute Unternehmensführungspraktiken sicherzustellen. Es wurde kein Referenzindikator zum Zweck der Erreichung des nachhaltigen Anlageziels des Produkts

festgelegt.

Wie weit das Produkt das nachhaltige Anlageziel erreicht, wird mittels folgender Nachhaltigkeitsindikatoren bemessen:

- Verhältnis der anhand der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix mit A und der mit B bewerteten Vermögenswerte. Bei den mit A bewerteten Emittenten wird davon ausgegangen, dass sie ein überlegenes ESG-Profil aufweisen, Branchenführer sind und sich für alle nachhaltigen Strategien eignen. Mit B bewertete Emittenten kommen für integrierte nachhaltige Strategien in Betracht;
- Kohlenstoffbilanz (Ansprüche für CO2-Emissionen pro Millionen investierten US-Dollar);
- Anteil von Anleihen mit Umwelt-, Sozial- oder Nachhaltigkeitslabel.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	100
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	0
ESG-Rating von JSS: Durchschnittliches Unternehmensrating	Von 0 (gering) bis 5 (hoch)	3,66
CO2-Fußabdruck	Tonnen CO2 pro investierter Million US-Dollar	23,7
Anteil von Anleihen mit Umwelt-, Sozial- oder Nachhaltigkeitslabel	Prozentualer Anteil	53

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators (J-1)
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	100	99
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	0	0
ESG-Rating von JSS: Durchschnittliches Unternehmensrating	Von 0 (gering) bis 5 (hoch)	3,66	3,63
CO2-Fußabdruck	Tonnen CO2 pro investierter Million US-Dollar	23,7	16,92
Anteil von Anleihen mit Umwelt-, Sozial- oder Nachhaltigkeitslabel	Prozentualer Anteil	53	53

Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?

Die Prüfung auf erhebliche Beeinträchtigungen (Do no significant harm, „DSNH“) schließt Emittenten aus, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellenwerte der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen nicht erreichen. Ein Emittent besteht die Prüfung, wenn er nach der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Bewertung A oder B erhält. Wenn der Emittent im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist, muss er außerdem über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügen, um die Prüfung zu bestehen. Zu den Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen gehören Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie Kraftwerks- und Koks Kohle.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen nach Maßgabe der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen im Rahmen des Investitionsprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten negativen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Investitionen erreicht, die die ökologischen oder sozialen Mindestschwellenwerte nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Mitwirkungsmaßnahmen dienen der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Die Definition des ESG-Auswahlverfahrens und Anlageuniversums beruht auf den Richtlinien und der Strategie von JSS für nachhaltiges Investieren, in denen die Prinzipien mehrerer internationaler Übereinkommen und Normen enthalten sind, u. a.:

Die Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen,

Die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

Der Global Compact der Vereinten Nationen,

Die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

Die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

Die Grundsätze zu Kinderrechten und unternehmerischem Handeln,

Die Arbeitsstandards der ILO,

Die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

Das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

Das Übereinkommen über Streumünzen.

Der ESG-Auswahlprozess trägt dazu bei, börsennotierte Unternehmen zu ermitteln, die vermeintlich gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung verstoßen, wie in den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte vorgesehen. Diese Unternehmen werden als unvereinbar mit den o. a. Prinzipien erachtet und aus dem Universum nachhaltiger Investitionen von JSS ausgeschlossen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Unternehmen

THG-Emissionen, CO₂-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind, Anteil des Verbrauchs und der Erzeugung von nicht erneuerbaren Energien, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (berücksichtigt für Ausschlüsse, Klimaversprechen und innerhalb der Nachhaltigkeitsmatrix)

Die schädlichsten Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe werden ausgeschlossen. Seit dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Umsätze aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 10\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 10\%$ aus einer Kombination aus dem Kraftwerkskohlebergbau und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

In Sektoren, in denen CO₂-Emissionen einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine CO₂-Emissionen. Dies umfasst eine Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Senkung der Emissionsintensität seines Kerngeschäfts, zur Senkung seines künftigen Energieverbrauchs oder seiner Treibhausgasemissionen (Scope 1, 2 und 3).

In Sektoren, in denen Möglichkeiten im Bereich der erneuerbaren Energien einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf erneuerbare Energien. Hierzu zählt auch die Bewertung der Kapazität eines Unternehmens im Bereich der erneuerbaren Energien.

Im Mai 2020 hat JSS ein Klimaversprechen abgegeben, das auf Klimaneutralität bis zum Jahr 2035 abzielt. Bei Fonds, bei denen dieses Versprechen bereits umgesetzt wurde, werden Treibhausgasemissionen anhand des CO₂-Fußabdrucks überwacht; diese Kontrollen werden für eine Teilmenge der Fonds durchgeführt. Die Einhaltung des Klimaversprechens wird mithilfe rückwärtsgerichteter Dekarbonisierungspfade überprüft, mit denen Übergangsrisiken gemindert werden sollen. Die meisten Fonds, die das Klimaversprechen umgesetzt haben, wenden folgende Methode an: Das ursprüngliche Ziel entspricht einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen des Referenzwerts um 30%. Diese Zielvorgabe wird in den folgenden Jahren um 7% verringert. Ab 2030 wird das Ziel linear gesenkt, bis das Netto-Null-Ziel im Jahr 2035 schließlich erreicht wird. Die THG-Emissionen des Portfolios auf der Grundlage der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro Mio. USD des Unternehmenswertes (EVIC) ausgedrückt.

Tätigkeiten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung wesentliche ESG-Faktoren darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf Biodiversität und Landnutzung. Hierzu zählt auch eine Bewertung der Auswirkungen der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens auf die Biodiversität. Zudem wird Palmöl konsequent ausgeschlossen.

Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Emissionen in Wasser (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Emissionen in Wasser erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Wasserbewirtschaftung. Die Wasserbewirtschaftung umfasst eine Bewertung wassereffizienter Produktionsprozesse, Trends bei der Wasserintensität sowie messbare, zeitlich befristete Zielvorgaben zur Senkung des Wasserverbrauchs. Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Gefährlicher Abfall (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Schadstoffemissionen und schädlichen Abfällen erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Schadstoffemissionen und seine Abfallwirtschaft. Der Umgang mit Schadstoffemissionen umfasst eine Bewertung der Bemühungen zur Kontrolle und Verringerung der Menge giftiger und krebserregender Nebenprodukte im Rahmen der Geschäftstätigkeit, Trends bei der Schadstofffreisetzung sowie messbare, zeitlich begrenzte Zielvorgaben zur Reduzierung von Schadstoffemissionen.

Verstöße gegen UNGC-Grundsätze (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Fehlende Prozesse zur Überwachung der Einhaltung des UNGC

Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Bestandteil der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Investitionsprozess einbeziehen, sobald die Offenlegungsquoten ausreichend sind. In der Zwischenzeit erfolgt eine ESG-Überwachung, bei der unter anderem regelmäßige Screenings auf Verstöße gegen die UNGC-Vorgaben durchgeführt werden. JSS strebt eine Berücksichtigung dieses Indikators an, sobald sich die Datenzuverlässigkeit und -verfügbarkeit verbessern.

Engagement in umstrittenen Waffen (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS wird seiner Verantwortung in Bezug auf umstrittene Waffen aktiv gerecht, indem es sie konzernweit ausschließt. JSS investiert keine Eigenmittel in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich der umstrittenen Waffen tätig sind. Ferner übernimmt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für solche Unternehmen bzw. keine Dienstleistungen im Zusammenhang mit Kapitalmärkten oder Fusionen und Übernahmen.

Staaten

THG-Emissionsintensität (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die externen Umweltkosten eines Landes. Bewertet werden unter anderem die Treibhausgasemissionen pro Kopf.

Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Landes in Bezug auf Grundrechte.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:
01.07.2023 – 30.06.2024

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
REGIERUNG DER NIEDERLANDE	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	3,50	NL
REGIERUNG DER NIEDERLANDE	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	2,74	NL
KFW	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,11	DE
BUNDESLAND NORDRHEIN- WESTFALEN	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	2,03	DE
EUROPÄISCHE UNION	Tätigkeiten gebietsfremder Organisationen und Stellen	1,68	SNAT
CASSA DEPOSITI E PRESTIT	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,66	IT
EUROPÄISCHE UNION	Tätigkeiten gebietsfremder Organisationen und Stellen	1,65	SNAT
EUROPÄISCHE UNION	Tätigkeiten gebietsfremder Organisationen und Stellen	1,57	SNAT
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	1,41	ES
CPPIB CAPITAL INC	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,39	CA
TISSEO	Verkehr und Lagerei	1,38	FR
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	1,32	ES
FRANKREICH (REGIERUNG VON)	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	1,27	FR
FRANKREICH (REGIERUNG VON)	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	1,27	FR
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	1,23	DE

Hauptinvestitionen per 30.06.2024 (Ende des Geschäftsjahres). Keine bedeutenden Abweichungen über das Geschäftsjahr.

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Die Gewichtung von Anleihen wird ermittelt, indem der Marktpreis der Anleihe (einschließlich aufgelaufener Zinsen) durch das Gesamtvermögen des Teilfonds geteilt wird.

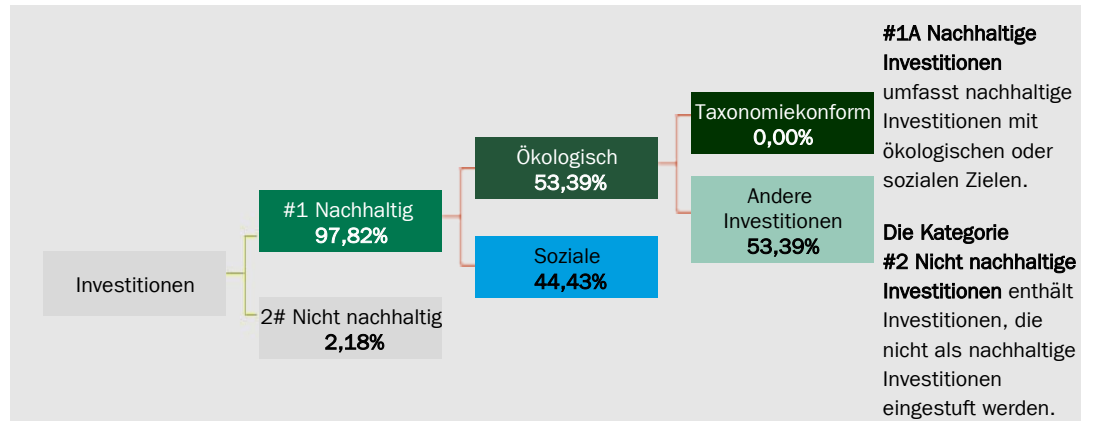


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 97,82%. 53,39% der Investitionen des Finanzprodukts waren ökologisch nachhaltige Investitionen, und 44,43% der Investitionen des Finanzprodukts waren sozial nachhaltige Investitionen. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Nicht nachhaltige Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Bezeichnung des Sektors	Anteil der Investitionen
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung – Allgemeine öffentliche Verwaltung	38,75%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Sonstige Kreditinstitute (ohne Spezialkreditinstitute)	18,01%
Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften - Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften	8,10%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Sonstige Finanzdienstleistungen außer Versicherungen und Pensionskassen (nicht anderweitig erfasst)	6,01%
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung – Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	5,76%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Fondsmanagement	3,44%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Spezialkreditinstitute	2,77%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	2,43%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Lebensversicherungen	2,29%
Verkehr und Lagerei – Verkehr und Lagerei	1,73%
Baugewerbe/Bau – Bau von Bahnverkehrsstrecken	1,18%
Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Grundstücks- und Wohnungswesen	0,99%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Nichtlebensversicherung	0,79%
Energieversorgung – Elektrizitätsübertragung	0,61%
Information und Kommunikation – Leitungsgebundene Telekommunikation	0,52%
Energieversorgung – Elektrizitätsverteilung	0,37%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Beteiligungsgesellschaften	0,36%
Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen – Vermietung von Kraftwagen mit einem Gesamtgewicht von 3,5 t oder weniger	0,36%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Bestrahlungs- und Elektrotherapiegeräten und elektromedizinischen Geräten	0,35%
Andere	5,19%

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** enthalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend; dieses Finanzprodukt hat sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel verpflichtet, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert(1)?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

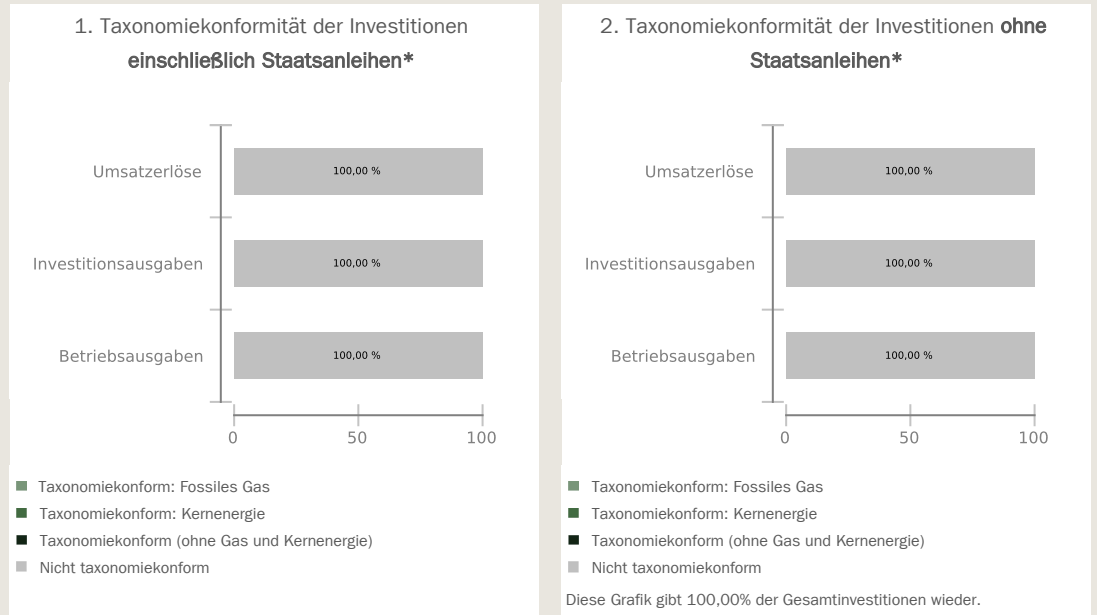
Nein

(1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind: 0,00%

Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind: 0,00%

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen	Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen (J-1)
0,00%	0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.



● **Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?**

Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden: 53,39%

Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein; allerdings ist der Anlageverwalter gegenwärtig nicht in der Lage, den Anteil der zugrundeliegenden Investitionen des Finanzprodukts, berechnet gemäß der EU-Taxonomie, genau anzugeben. Diese Position wird jedoch weiterhin geprüft, während die zugrundeliegenden Regelungen im Laufe der Zeit fertiggestellt und mehr zuverlässige Daten verfügbar werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil nachhaltiger Investitionen mit einem sozialen Ziel: 44,43%



Welche Investitionen fielen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Nicht nachhaltige Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erreichung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts folgte einem rigorosen Verfahren, bei dem durchgängig ESG-Aspekte berücksichtigt wurden. Der Anlageverwalter wendete bei seiner Strategie die folgenden verbindlichen Kriterien an:

(a) Ausschluss von Anlagen in umstrittenen Geschäftsaktivitäten gemäß den Ausschlussrichtlinien von JSS;

(b) Erreichung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte nicht in mit C oder D bewertete Emittenten.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt das nachhaltige Investitionsziel erreicht.

Name des Produkts: JSS Investmentfonds SICAV – JSS Sustainable Bond – EUR Corporates
 Unternehmenskennung (LEI-Code): 5493000DE4AHUU0FOY34

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 84,30% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt integriert umweltbezogene, soziale und die Unternehmensführung betreffende Aspekte („ESG“) in den Investitionsprozess mit dem Ziel, ein überdurchschnittlich gutes ESG-Profil für das gesamte Portfolio gemäß der von J. Safra Sarasin („JSS“) entwickelten Nachhaltigkeitsmatrix zu erreichen.

Das ESG-Rating von JSS bewertet die Emittenten im Verhältnis zu ihrer Vergleichsgruppe und reicht von A für Emittenten, die in die Spitzenklasse eingestuft werden, bis zu D für Emittenten, die ggf. eine umstrittene Geschäftstätigkeit ausüben. Beim nachhaltigen Investieren werden Emittenten, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und bei denen die Wahrscheinlichkeit für erhebliche Beeinträchtigungen daher erhöht ist, mit C (schlechteste Leistung im Branchenvergleich) oder D (wegen umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse von Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, die Kreditratings von Staaten unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien zu analysieren. JSS misst die nachhaltige Wirtschaftsleistung eines Landes nach (i) der Verfügbarkeit von natürlichen Ressourcen und (ii) danach, wie effizient diese eingesetzt werden. Die Nachhaltigkeitsbewertungen von Ländern stellen ein ergänzendes Instrument der finanziellen Analyse ihrer Kreditratings dar.

Folgende Ausschlusskriterien (mit Umsatzschwellen) wurden im Berichtszeitraum auf das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Waffenarten, die angesichts ihrer langfristigen humanitären Folgen und/oder der großen Anzahl ziviler Opfer bei ihrem Einsatz als umstritten

eingestuft werden. Dazu zählen u. a. biologische, chemische und atomare Waffen, Streumunition und Anti-Personenminen (Umsatzschwelle: 0%);

- Verteidigung und Rüstung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und wesentliche Bauteile) sowie Hilfssysteme und Dienstleistungen im Zusammenhang mit Waffen (Waffeneinsatzsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5%);

- Kohle: Unternehmen, die in erheblichem Umfang im Kohlegeschäft tätig sind und zugleich keine solide Strategie für den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft vorweisen können (Umsatzschwelle: 5% für den Kohlebergbau, 10% für die Kohleverstromung sowie 10% für die Summe aus beiden Komponenten);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen zwecks landwirtschaftlicher Nutzung gentechnisch verändern (Umsatzschwelle: 0%);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0%);

- Tabak: Hersteller von Tabakprodukten (Umsatzschwelle: 5%);

- Erwachsenenunterhaltung: Produzenten von Erwachsenenunterhaltung (Umsatzschwelle: 5%);

- Verstöße gegen Menschenrechte und sonstige Prinzipien des Global Compact: Unternehmen, die nach Maßgabe anerkannter internationaler Standards an schweren Verstößen gegen Menschenrechte oder sonstige Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen beteiligt sind (Umsatzschwelle: 0%).

- Palmöl: Unternehmen mit einem Bezug zu Palmöl ohne ausreichende Zertifizierung durch den Roundtable on Sustainable Palm Oil („RSPO“) werden ausgeschlossen (Umsatzschwelle: 5% für Palmölproduzenten, wenn weniger als 75% der Standorte eine RSPO-Zertifizierung besitzen).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Zeitpunkt dar. Bei nachhaltigen Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem sozialen Ziel beitragen, wird davon ausgegangen, dass sie zu beiden gleichermaßen beitragen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● *Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?*

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	100
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	0

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators (J-1)
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	100	98
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	0	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der CO₂-Emissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren Zielen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) in Einklang stehen, oder durch die Einnahme einer Spitzenposition im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren innerhalb der Vergleichsgruppe.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Prüfung auf erhebliche Beeinträchtigungen (Do no significant harm, „DSNH“) schließt Emittenten aus, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellenwerte der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen nicht erreichen. Ein Emittent besteht die Prüfung, wenn er nach der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Bewertung A oder B erhält. Wenn der Emittent im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist, muss er außerdem über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügen, um die Prüfung zu bestehen. Zu den Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen gehören Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie Kraftwerks- und Koks Kohle.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen nach Maßgabe der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen im Rahmen des Investitionsprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten negativen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Investitionen erreicht, die die ökologischen oder sozialen Mindestschwellenwerte nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Mitwirkungsmaßnahmen dienen der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Die Definition des ESG-Auswahlverfahrens und Anlageuniversums beruht auf den

Richtlinien und der Strategie von JSS für nachhaltiges Investieren, in denen die Prinzipien mehrerer internationaler Übereinkommen und Normen enthalten sind, u. a.:

Die Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen,

Die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

Der Global Compact der Vereinten Nationen,

Die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

Die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

Die Grundsätze zu Kinderrechten und unternehmerischem Handeln,

Die Arbeitsstandards der ILO,

Die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

Das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

Das Übereinkommen über Streumunition.

Der ESG-Auswahlprozess trägt dazu bei, börsennotierte Unternehmen zu ermitteln, die vermeintlich gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung verstoßen, wie in den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte vorgesehen. Diese Unternehmen werden als unvereinbar mit den o. a. Prinzipien erachtet und aus dem Universum nachhaltiger Investitionen von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Unternehmen

THG-Emissionen, CO₂-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind, Anteil des Verbrauchs und der Erzeugung von nicht erneuerbaren Energien, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (berücksichtigt für Ausschlüsse, Klimaversprechen und innerhalb der Nachhaltigkeitsmatrix)

Die schädlichsten Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe werden ausgeschlossen. Seit dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Umsätze aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 10\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 10\%$ aus einer Kombination aus dem Kraftwerkskohlebergbau und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

In Sektoren, in denen CO₂-Emissionen einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine CO₂-Emissionen. Dies umfasst eine Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Senkung der Emissionsintensität seines Kerngeschäfts, zur Senkung seines künftigen Energieverbrauchs oder seiner Treibhausgasemissionen (Scope 1, 2 und 3).

In Sektoren, in denen Möglichkeiten im Bereich der erneuerbaren Energien einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf erneuerbare Energien. Hierzu zählt auch die Bewertung der Kapazität eines Unternehmens im Bereich der erneuerbaren Energien.

Im Mai 2020 hat JSS ein Klimaversprechen abgegeben, das auf Klimaneutralität bis zum Jahr 2035 abzielt. Bei Fonds, bei denen dieses Versprechen bereits umgesetzt wurde, werden Treibhausgasemissionen anhand des CO₂-Fußabdrucks überwacht; diese Kontrollen werden für eine Teilmenge der Fonds durchgeführt. Die Einhaltung des Klimaversprechens wird mithilfe rückwärtsgerichteter Dekarbonisierungspfade überprüft, mit denen Übergangsrisiken gemindert werden sollen. Die meisten Fonds, die das Klimaversprechen umgesetzt haben, wenden folgende Methode an: Das ursprüngliche Ziel entspricht einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen des Referenzwerts um 30%. Diese Zielvorgabe wird in den folgenden Jahren um 7% verringert. Ab 2030 wird das Ziel linear gesenkt, bis das Netto-Null-Ziel im Jahr 2035 schließlich erreicht wird. Die THG-Emissionen des Portfolios auf der Grundlage der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro Mio. USD des Unternehmenswertes (EVIC) ausgedrückt.

Tätigkeiten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung wesentliche ESG-Faktoren darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf Biodiversität und Landnutzung. Hierzu zählt auch eine Bewertung der Auswirkungen der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens auf die Biodiversität. Zudem wird Palmöl konsequent ausgeschlossen.

Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Emissionen in Wasser (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Emissionen in Wasser erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Wasserbewirtschaftung. Die Wasserbewirtschaftung umfasst eine Bewertung wassereffizienter Produktionsprozesse, Trends bei der Wasserintensität sowie messbare, zeitlich befristete Zielvorgaben zur Senkung des Wasserverbrauchs. Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Gefährlicher Abfall (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Schadstoffemissionen und schädlichen Abfällen erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Schadstoffemissionen und seine Abfallwirtschaft. Der Umgang mit Schadstoffemissionen umfasst eine Bewertung der Bemühungen zur Kontrolle und Verringerung der Menge giftiger und krebserregender Nebenprodukte im Rahmen der Geschäftstätigkeit, Trends bei der Schadstofffreisetzung sowie messbare, zeitlich begrenzte Zielvorgaben zur Reduzierung von Schadstoffemissionen.

Verstöße gegen UNGC-Grundsätze (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Fehlende Prozesse zur Überwachung der Einhaltung des UNGC

Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Bestandteil der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Investitionsprozess einbeziehen, sobald die Offenlegungsquoten ausreichend

sind. In der Zwischenzeit erfolgt eine ESG-Überwachung, bei der unter anderem regelmäßige Screenings auf Verstöße gegen die UNGC-Vorgaben durchgeführt werden. JSS strebt eine Berücksichtigung dieses Indikators an, sobald sich die Datenzuverlässigkeit und -verfügbarkeit verbessern.

Engagement in umstrittenen Waffen (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS wird seiner Verantwortung in Bezug auf umstrittene Waffen aktiv gerecht, indem es sie konzernweit ausschließt. JSS investiert keine Eigenmittel in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich der umstrittenen Waffen tätig sind. Ferner übernimmt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für solche Unternehmen bzw. keine Dienstleistungen im Zusammenhang mit Kapitalmärkten oder Fusionen und Übernahmen.

Staaten

THG-Emissionsintensität (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die externen Umweltkosten eines Landes. Bewertet werden unter anderem die Treibhausgasemissionen pro Kopf.

Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Landes in Bezug auf Grundrechte.



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 – 30.06.2024

Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
DEUTSCHE BAHN FIN GMBH	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,67	DE
UNIPOLSAI ASSICURAZIONI	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,38	IT
GN STORE NORD	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,38	DK
VR-YHTYMA OY	Verkehr und Lagerei	1,23	FI
ARGENTUM (SWISS LIFE)	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	1,20	NL
ATHORA HOLDING LTD	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,98	BM
PROCREDIT HOLDING AG	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,97	DE
UNILEVER FINANCE	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,94	NL
NOVO NORDISK A/S	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,93	DK
NOVO NORDISK A/S	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,93	DK
KBC GROUP NV	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,92	BE
BANQUE FED CRED MUTUEL	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,89	FR
JOHNSON & JOHNSON	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,87	US
E.ON SE	Energieversorgung	0,83	DE
ERSTE GROUP BANK AG	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,83	AT

Hauptinvestitionen per 30.06.2024 (Ende des Geschäftsjahres). Keine bedeutenden Abweichungen über das Geschäftsjahr.

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Die Gewichtung von Anleihen wird ermittelt, indem der Marktpreis der Anleihe (einschließlich aufgelaufener Zinsen) durch das Gesamtvermögen des Teilfonds geteilt wird.



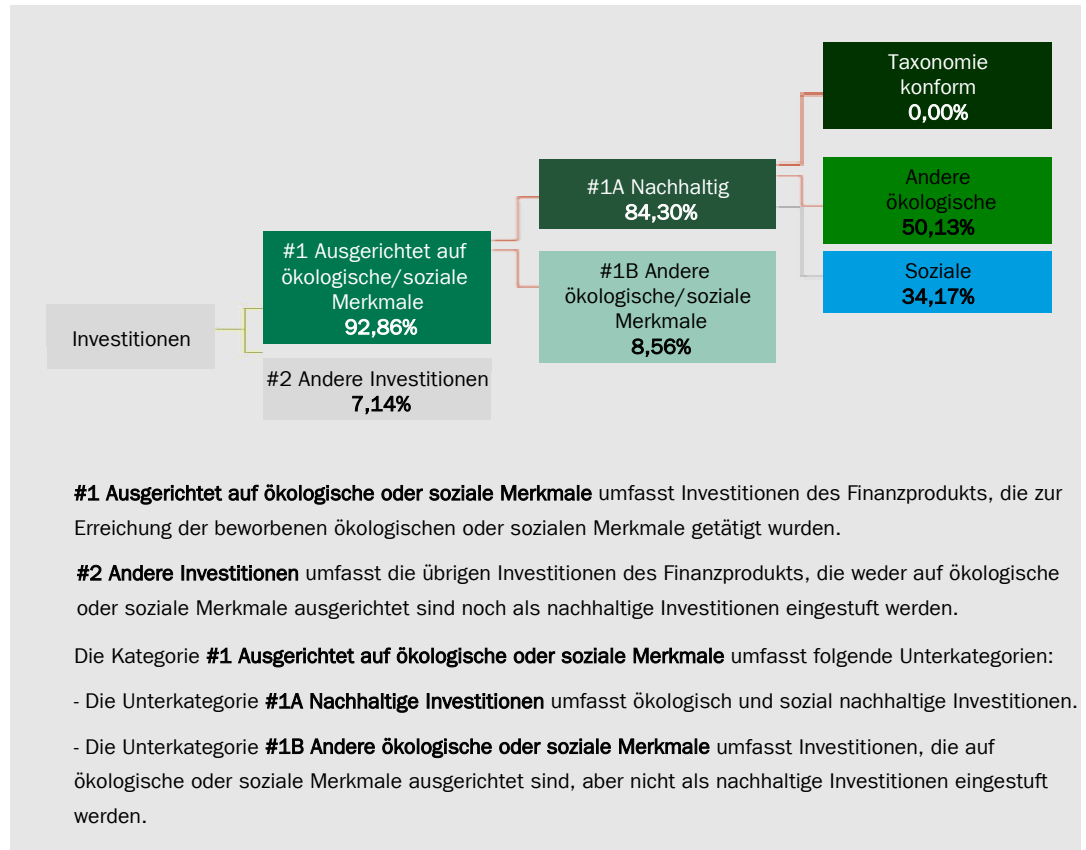
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 84,3%.

50,13% der Investitionen des Finanzprodukts waren ökologisch nachhaltige Investitionen, und 34,17% der Investitionen des Finanzprodukts waren sozial nachhaltige Investitionen. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Bezeichnung des Sektors	Anteil der Investitionen
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Sonstige Kreditinstitute (ohne Spezialkreditinstitute)	35,52%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	12,12%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Fondsmanagement	6,99%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Lebensversicherungen	3,62%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Nichtlebensversicherung	2,15%
Energieversorgung – Elektrizitäts-, Gas-, Wärme- und Kälteversorgung	1,86%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Maschinenbau	1,83%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Nahrungs- und Futtermitteln	1,83%
Information und Kommunikation – Telekommunikation	1,79%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von pharmazeutischen Erzeugnissen	1,63%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Institutionen für Finanzierungsleasing	1,45%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Getränkeherstellung	1,38%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Bestrahlungs- und Elektrotherapiegeräten und elektromedizinischen Geräten	1,38%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Beteiligungsgesellschaften	1,36%
Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Grundstücks- und Wohnungswesen	1,33%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Geräten und Einrichtungen der Telekommunikationstechnik	1,29%
Verkehr und Lagerei – Verkehr und Lagerei	1,23%
Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Vermietung, Verpachtung von eigenen oder geleasteten Grundstücken, Gebäuden und Wohnungen	1,21%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Spezialkreditinstitute	1,20%
Andere	18,85%

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** enthalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend; dieses Finanzprodukt hat sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel verpflichtet, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert(1)?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

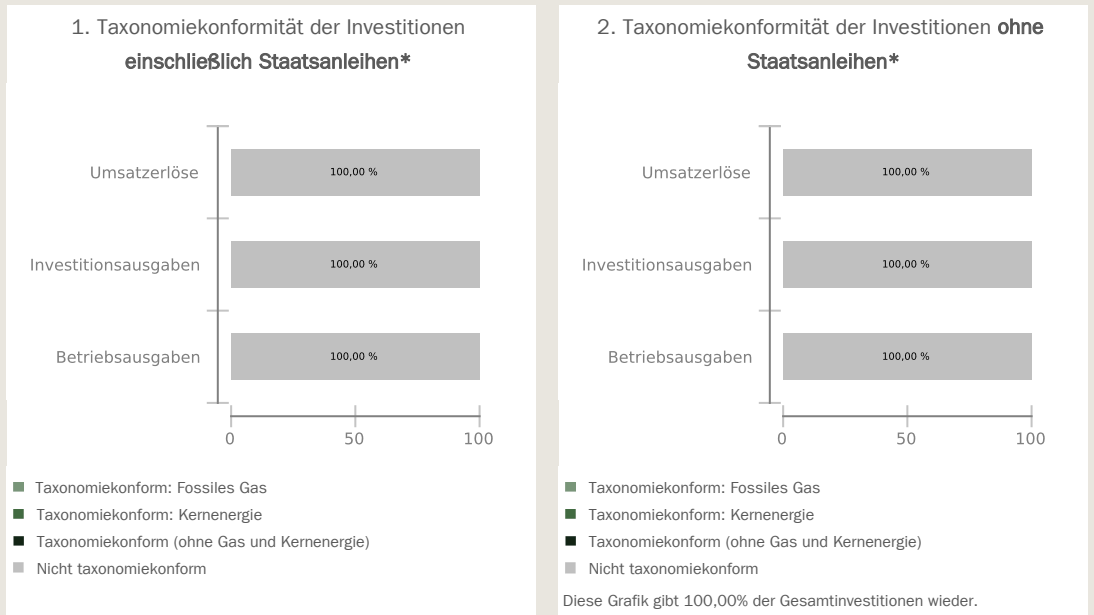
Nein

(1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind: 0,00%

Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind: 0,00%

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen	Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen (J-1)
0,00%	0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden: 50,13%

Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein; allerdings ist der Anlageverwalter gegenwärtig nicht in der Lage, den Anteil der zugrundeliegenden Investitionen des Finanzprodukts, berechnet gemäß der EU-Taxonomie, genau anzugeben. Diese Position wird jedoch weiterhin geprüft, während die zugrundeliegenden Regelungen im Laufe der Zeit fertiggestellt und mehr zuverlässige Daten verfügbar werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen: 34,17%



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts folgte einem rigorosen Verfahren, bei dem durchgängig ESG-Aspekte berücksichtigt wurden. Der Anlageverwalter wendete bei seiner Strategie die folgenden verbindlichen Kriterien an:

(a) Ausschluss von Anlagen in umstrittenen Geschäftsaktivitäten gemäß den Ausschlussrichtlinien von JSS;

(b) Erreichung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte nicht in mit C oder D bewertete Emittenten.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Name des Produkts: JSS Investmentfonds SICAV – JSS Sustainable Equity – Europe
 Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300Q02Q3MPXCK2Y95

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : __% <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 79,30% an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt integriert umweltbezogene, soziale und die Unternehmensführung betreffende Aspekte („ESG“) in den Investitionsprozess mit dem Ziel, ein überdurchschnittlich gutes ESG-Profil für das gesamte Portfolio gemäß der von J. Safra Sarasin („JSS“) entwickelten Nachhaltigkeitsmatrix zu erreichen.

Das ESG-Rating von JSS bewertet die Emittenten im Verhältnis zu ihrer Vergleichsgruppe und reicht von A für Emittenten, die in die Spitzenklasse eingestuft werden, bis zu D für Emittenten, die ggf. eine umstrittene Geschäftstätigkeit ausüben. Beim nachhaltigen Investieren werden Emittenten, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und bei denen die Wahrscheinlichkeit für erhebliche Beeinträchtigungen daher erhöht ist, mit C (schlechteste Leistung im Branchenvergleich) oder D (wegen umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse von Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, die Kreditratings von Staaten unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien zu analysieren. JSS misst die nachhaltige Wirtschaftsleistung eines Landes nach (i) der Verfügbarkeit von natürlichen Ressourcen und (ii) danach, wie effizient diese eingesetzt werden. Die Nachhaltigkeitsbewertungen von Ländern stellen ein ergänzendes Instrument der finanziellen Analyse ihrer Kreditratings dar.

Folgende Ausschlusskriterien (mit Umsatzschwellen) wurden im Berichtszeitraum auf das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Waffenarten, die angesichts ihrer langfristigen humanitären Folgen und/oder der großen Anzahl ziviler Opfer bei ihrem Einsatz als umstritten

eingestuft werden. Dazu zählen u. a. biologische, chemische und atomare Waffen, Streumunition und Anti-Personenminen (Umsatzschwelle: 0%);

- Verteidigung und Rüstung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und wesentliche Bauteile) sowie Hilfssysteme und Dienstleistungen im Zusammenhang mit Waffen (Waffeneinsatzsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5%);

- Kohle: Unternehmen, die in erheblichem Umfang im Kohlegeschäft tätig sind und zugleich keine solide Strategie für den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft vorweisen können (Umsatzschwelle: 5% für den Kohlebergbau, 10% für die Kohleverstromung sowie 10% für die Summe aus beiden Komponenten);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen zwecks landwirtschaftlicher Nutzung gentechnisch verändern (Umsatzschwelle: 0%);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0%);

- Tabak: Hersteller von Tabakprodukten (Umsatzschwelle: 5%);

- Erwachsenenunterhaltung: Produzenten von Erwachsenenunterhaltung (Umsatzschwelle: 5%);

- Verstöße gegen Menschenrechte und sonstige Prinzipien des Global Compact: Unternehmen, die nach Maßgabe anerkannter internationaler Standards an schweren Verstößen gegen Menschenrechte oder sonstige Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen beteiligt sind (Umsatzschwelle: 0%).

- Palmöl: Unternehmen mit einem Bezug zu Palmöl ohne ausreichende Zertifizierung durch den Roundtable on Sustainable Palm Oil („RSPO“) werden ausgeschlossen (Umsatzschwelle: 5% für Palmölproduzenten, wenn weniger als 75% der Standorte eine RSPO-Zertifizierung besitzen).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Zeitpunkt dar. Bei nachhaltigen Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem sozialen Ziel beitragen, wird davon ausgegangen, dass sie zu beiden gleichermaßen beitragen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● *Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?*

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	97
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	3

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators (J-1)
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	97	100
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	3	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der CO₂-Emissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren Zielen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) in Einklang stehen, oder durch die Einnahme einer Spitzenposition im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren innerhalb der Vergleichsgruppe.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Prüfung auf erhebliche Beeinträchtigungen (Do no significant harm, „DSNH“) schließt Emittenten aus, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellenwerte der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen nicht erreichen. Ein Emittent besteht die Prüfung, wenn er nach der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Bewertung A oder B erhält. Wenn der Emittent im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist, muss er außerdem über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügen, um die Prüfung zu bestehen. Zu den Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen gehören Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie Kraftwerks- und Koks Kohle.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen nach Maßgabe der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen im Rahmen des Investitionsprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten negativen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Investitionen erreicht, die die ökologischen oder sozialen Mindestschwellenwerte nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Mitwirkungsmaßnahmen dienen der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Die Definition des ESG-Auswahlverfahrens und Anlageuniversums beruht auf den

Richtlinien und der Strategie von JSS für nachhaltiges Investieren, in denen die Prinzipien mehrerer internationaler Übereinkommen und Normen enthalten sind, u. a.:

Die Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen,

Die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

Der Global Compact der Vereinten Nationen,

Die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

Die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

Die Grundsätze zu Kinderrechten und unternehmerischem Handeln,

Die Arbeitsstandards der ILO,

Die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

Das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

Das Übereinkommen über Streumunition.

Der ESG-Auswahlprozess trägt dazu bei, börsennotierte Unternehmen zu ermitteln, die vermeintlich gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung verstoßen, wie in den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte vorgesehen. Diese Unternehmen werden als unvereinbar mit den o. a. Prinzipien erachtet und aus dem Universum nachhaltiger Investitionen von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Unternehmen

THG-Emissionen, CO₂-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind, Anteil des Verbrauchs und der Erzeugung von nicht erneuerbaren Energien, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (berücksichtigt für Ausschlüsse, Klimaversprechen und innerhalb der Nachhaltigkeitsmatrix)

Die schädlichsten Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe werden ausgeschlossen. Seit dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Umsätze aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 10\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 10\%$ aus einer Kombination aus dem Kraftwerkskohlebergbau und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

In Sektoren, in denen CO₂-Emissionen einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine CO₂-Emissionen. Dies umfasst eine Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Senkung der Emissionsintensität seines Kerngeschäfts, zur Senkung seines künftigen Energieverbrauchs oder seiner Treibhausgasemissionen (Scope 1, 2 und 3).

In Sektoren, in denen Möglichkeiten im Bereich der erneuerbaren Energien einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf erneuerbare Energien. Hierzu zählt auch die Bewertung der Kapazität eines Unternehmens im Bereich der erneuerbaren Energien.

Im Mai 2020 hat JSS ein Klimaversprechen abgegeben, das auf Klimaneutralität bis zum Jahr 2035 abzielt. Bei Fonds, bei denen dieses Versprechen bereits umgesetzt wurde, werden Treibhausgasemissionen anhand des CO₂-Fußabdrucks überwacht; diese Kontrollen werden für eine Teilmenge der Fonds durchgeführt. Die Einhaltung des Klimaversprechens wird mithilfe rückwärtsgerichteter Dekarbonisierungspfade überprüft, mit denen Übergangsrisiken gemindert werden sollen. Die meisten Fonds, die das Klimaversprechen umgesetzt haben, wenden folgende Methode an: Das ursprüngliche Ziel entspricht einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen des Referenzwerts um 30%. Diese Zielvorgabe wird in den folgenden Jahren um 7% verringert. Ab 2030 wird das Ziel linear gesenkt, bis das Netto-Null-Ziel im Jahr 2035 schließlich erreicht wird. Die THG-Emissionen des Portfolios auf der Grundlage der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro Mio. USD des Unternehmenswertes (EVIC) ausgedrückt.

Tätigkeiten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung wesentliche ESG-Faktoren darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf Biodiversität und Landnutzung. Hierzu zählt auch eine Bewertung der Auswirkungen der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens auf die Biodiversität. Zudem wird Palmöl konsequent ausgeschlossen.

Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Emissionen in Wasser (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Emissionen in Wasser erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Wasserbewirtschaftung. Die Wasserbewirtschaftung umfasst eine Bewertung wassereffizienter Produktionsprozesse, Trends bei der Wasserintensität sowie messbare, zeitlich befristete Zielvorgaben zur Senkung des Wasserverbrauchs. Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Gefährlicher Abfall (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Schadstoffemissionen und schädlichen Abfällen erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Schadstoffemissionen und seine Abfallwirtschaft. Der Umgang mit Schadstoffemissionen umfasst eine Bewertung der Bemühungen zur Kontrolle und Verringerung der Menge giftiger und krebserregender Nebenprodukte im Rahmen der Geschäftstätigkeit, Trends bei der Schadstofffreisetzung sowie messbare, zeitlich begrenzte Zielvorgaben zur Reduzierung von Schadstoffemissionen.

Verstöße gegen UNGC-Grundsätze (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Fehlende Prozesse zur Überwachung der Einhaltung des UNGC

Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Bestandteil der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Investitionsprozess einbeziehen, sobald die Offenlegungsquoten ausreichend

sind. In der Zwischenzeit erfolgt eine ESG-Überwachung, bei der unter anderem regelmäßige Screenings auf Verstöße gegen die UNGC-Vorgaben durchgeführt werden. JSS strebt eine Berücksichtigung dieses Indikators an, sobald sich die Datenzuverlässigkeit und -verfügbarkeit verbessern.

Engagement in umstrittenen Waffen (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS wird seiner Verantwortung in Bezug auf umstrittene Waffen aktiv gerecht, indem es sie konzernweit ausschließt. JSS investiert keine Eigenmittel in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich der umstrittenen Waffen tätig sind. Ferner übernimmt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für solche Unternehmen bzw. keine Dienstleistungen im Zusammenhang mit Kapitalmärkten oder Fusionen und Übernahmen.

Staaten

THG-Emissionsintensität (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die externen Umweltkosten eines Landes. Bewertet werden unter anderem die Treibhausgasemissionen pro Kopf.

Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Landes in Bezug auf Grundrechte.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 – 30.06.2024

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
ASML HOLDING NV	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	6,25	NL
ASTRAZENECA PLC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,80	GB
NESTLE SA-REG	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,54	CH
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,08	FR
UNILEVER PLC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,06	GB
ALLIANZ SE-REG	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	3,59	DE
SCHNEIDER ELECTRIC SE	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,55	FR
L'OREAL	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,33	FR
NORDEA BANK ABP	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	3,30	FI
NOVO NORDISK A/S-B	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,27	DK
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	Information und Kommunikation	3,24	NL
ATLAS COPCO AB-A SHS	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,01	SE
SHELL PLC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,97	GB
AMADEUS IT GROUP SA	Information und Kommunikation	2,87	ES

Hauptinvestitionen per 30.06.2024 (Ende des Geschäftsjahres). Keine bedeutenden Abweichungen über das Geschäftsjahr.

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.



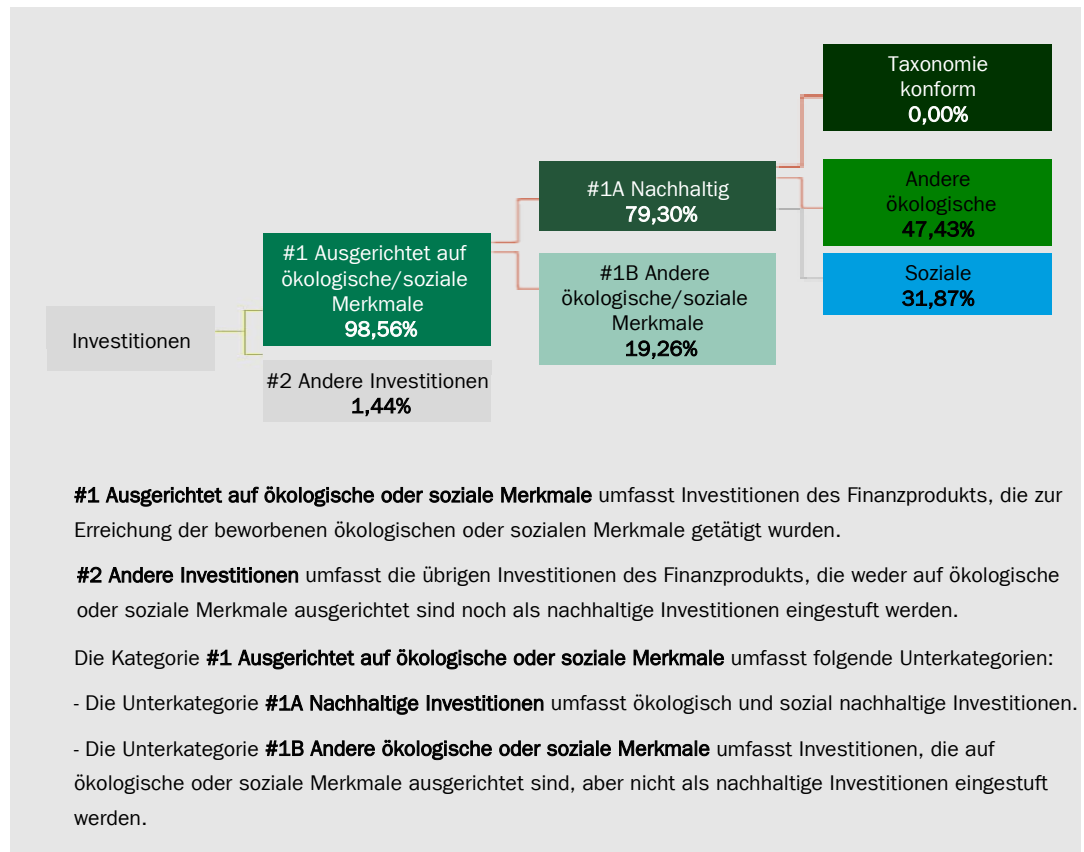
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 79,3%.

47,43% der Investitionen des Finanzprodukts waren ökologisch nachhaltige Investitionen, und 31,87% der Investitionen des Finanzprodukts waren sozial nachhaltige Investitionen. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Bezeichnung des Sektors	Anteil der Investitionen
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von pharmazeutischen Erzeugnissen	12,59%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Sonstige Kreditinstitute (ohne Spezialkreditinstitute)	7,48%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Maschinen für sonstige bestimmte Wirtschaftszweige a. n. g.	6,25%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Papier, Pappe und Waren daraus	5,57%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Nichtlebensversicherung	4,83%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Nahrungs- und Futtermitteln	4,54%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von sonstiger Oberbekleidung	4,08%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Mineralölverarbeitung	3,90%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Lebensversicherungen	3,59%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von elektrischem Installationsmaterial	3,55%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Körperpflegemitteln und Duftstoffen	3,33%
Information und Kommunikation – Tonstudios; Herstellung von Hörfunkbeiträgen; Verlegen von bespielten Tonträgern und Musikalien	3,24%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	3,19%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Maschinenbau	3,01%
Information und Kommunikation – Erbringung von Beratungsleistungen auf dem Gebiet der Informationstechnologie	2,87%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Beteiligungsgesellschaften	2,73%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von sonstigen Waren	2,64%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Hebezeugen und Fördermitteln	2,63%
Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen – Vermietung von beweglichen Sachen	2,60%
Andere	17,39%

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** enthalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend; dieses Finanzprodukt hat sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel verpflichtet, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert(1)?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

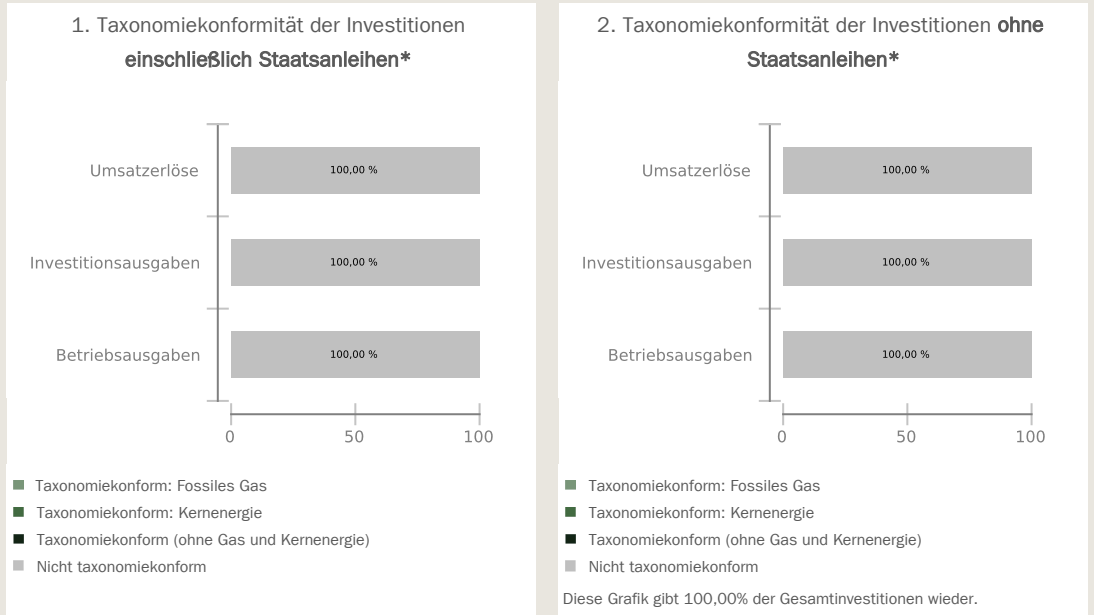
Nein

(1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind: 0,00%

Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind: 0,00%

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen	Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen (J-1)
0,00%	0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden: 47,43%

Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein; allerdings ist der Anlageverwalter gegenwärtig nicht in der Lage, den Anteil der zugrundeliegenden Investitionen des Finanzprodukts, berechnet gemäß der EU-Taxonomie, genau anzugeben. Diese Position wird jedoch weiterhin geprüft, während die zugrundeliegenden Regelungen im Laufe der Zeit fertiggestellt und mehr zuverlässige Daten verfügbar werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen: 31,87%



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts folgte einem rigorosen Verfahren, bei dem durchgängig ESG-Aspekte berücksichtigt wurden. Der Anlageverwalter wendete bei seiner Strategie die folgenden verbindlichen Kriterien an:

(a) Ausschluss von Anlagen in umstrittenen Geschäftsaktivitäten gemäß den Ausschlussrichtlinien von JSS;

(b) Erreichung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte nicht in mit C oder D bewertete Emittenten.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Regelmäßige Informationen zu den in Artikel 9 Absätze 1 bis 4a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 5 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

Name des Produkts: JSS Investmentfonds SICAV – JSS Sustainable Equity – Global Climate 2035
Unternehmenskennung (LEI-Code): 54930008UKU4KUKTFM60

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="checkbox"/> Nein
<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: 67,48%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es __% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input checked="" type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 31,16%	<input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Ziel des Produkts ist es, die CO₂-Bilanz (Angaben zu den CO₂-Emissionen pro investierter Million US-Dollar) im Laufe der Zeit zu verringern, bis entsprechend dem Klimaversprechen von JSS im Jahr 2035 CO₂-Neutralität erreicht ist. Die Methodik des Zielfestsetzungsprozesses ergibt sich aus der Klimawandel-Benchmarkverordnung der EU, wobei das Ziel darin besteht, die Kohlenstoffbilanz (Ansprüche für CO₂-Emissionen pro Millionen investierten US-Dollar) unter einem bestimmten Schwellenwert von -30% unterhalb der Kohlenstoffbilanz des Referenzindikators des Fonds zu halten. Der Schwellenwert wird bis 2030 jedes Jahr um mindestens 7% gesenkt, entsprechend oder über dem Dekarbonisierungspfad des 1,5 °C-Szenarios des Weltklimarats („IPCC“) (ohne oder nur mit begrenzter Überschreitung). Es wird angestrebt, die CO₂-Bilanz des Teilfonds von 2030 bis 2035 auf (Netto-)Null zu senken. Zu diesem Zweck investierte das Produkt in „Umweltchampions“, d. h. in Unternehmen, die eine erhebliche Verringerung der Emissionen durch innovative Lösungen ermöglichen, und Unternehmen mit „Umweltverpflichtung“, d. h. Unternehmen, die im Einklang mit dem Pariser Abkommen eine Begrenzung des Temperaturanstiegs auf weniger als 2 °C anstreben. Dieser Anlageansatz ermöglicht es den Anlegern, in Bezug auf den Klimawandel Gelegenheiten zu nutzen und Risiken zu mindern. Das Portfolio bestand aus Emittenten, die eine Begrenzung des Temperaturanstiegs auf unter 2 °C anstreben, einen großen Teil ihrer Erträge umweltfreundlich erwirtschafteten und nicht in „Stranded Assets“ engagiert waren. Außerdem strebte das Finanzprodukt ein überdurchschnittliches ESG-Profil für das gesamte Portfolio auf der Grundlage der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix an, um nachhaltige Geschäftspraktiken zu fördern. Das Finanzprodukt zielte darauf ab, zu einer Reihe ökologischer Ziele beizutragen, darunter Bekämpfung des Klimawandels, Anpassung an den Klimawandel, nachhaltige Nutzung und Schutz von Wasser- und Meeresressourcen, Übergang zur Kreislaufwirtschaft, Vermeidung und Verminderung der Umweltverschmutzung sowie Schutz und Wiederherstellung der Biodiversität und der Ökosysteme.

Der Schwerpunkt lag auf der Bekämpfung des Klimawandels, der Anpassung an den Klimawandel und der nachhaltigen Nutzung und dem Schutz von Wasser- und Meeresressourcen. Als Referenzwert wurde der MSCI World Climate Paris Aligned Net Return benannt.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	100
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	0
ESG-Rating von JSS: Durchschnittliches Unternehmensrating	Von 0 (gering) bis 5 (hoch)	3,49
CO2-Fußabdruck	Tonnen CO2 pro investierter Million US-Dollar	9,88
Durchschnittlicher Anteil von „grünen“ Erträgen am Gesamtertrag	Prozentualer Anteil	31
Klimaentwicklung	Grad Celsius	1,78

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators (J-1)
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	100	100
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	0	0
ESG-Rating von JSS: Durchschnittliches Unternehmensrating	Von 0 (gering) bis 5 (hoch)	3,49	3,4
CO2-Fußabdruck	Tonnen CO2 pro investierter Million US-Dollar	9,88	14,56
Durchschnittlicher Anteil von „grünen“ Erträgen am Gesamtertrag	Prozentualer Anteil	31	29
Klimaentwicklung	Grad Celsius	1,78	1,72

Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?

Die Prüfung auf erhebliche Beeinträchtigungen (Do no significant harm, „DSNH“) schließt Emittenten aus, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellenwerte der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen nicht erreichen. Ein Emittent besteht die Prüfung, wenn er nach der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Bewertung A oder B erhält. Wenn der Emittent im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist, muss er außerdem über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügen, um die Prüfung zu bestehen. Zu den Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen gehören Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie Kraftwerks- und Koks Kohle.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen nach Maßgabe der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen im Rahmen des Investitionsprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten negativen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Investitionen erreicht, die die ökologischen oder sozialen Mindestschwellenwerte nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Mitwirkungsmaßnahmen dienen der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Die Definition des ESG-Auswahlverfahrens und Anlageuniversums beruht auf den Richtlinien und der Strategie von JSS für nachhaltiges Investieren, in denen die Prinzipien mehrerer internationaler Übereinkommen und Normen enthalten sind, u. a.:

Die Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen,

Die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

Der Global Compact der Vereinten Nationen,

Die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

Die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

Die Grundsätze zu Kinderrechten und unternehmerischem Handeln,

Die Arbeitsstandards der ILO,

Die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

Das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

Das Übereinkommen über Streumunition.

Der ESG-Auswahlprozess trägt dazu bei, börsennotierte Unternehmen zu ermitteln, die vermeintlich gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung verstoßen, wie in den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte vorgesehen. Diese Unternehmen werden als unvereinbar mit den o. a. Prinzipien erachtet und aus dem Universum nachhaltiger Investitionen von JSS ausgeschlossen.

Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Unternehmen

THG-Emissionen, CO2-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind, Anteil des Verbrauchs und der Erzeugung von nicht erneuerbaren Energien, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (berücksichtigt für Ausschlüsse, Klimaversprechen und innerhalb der Nachhaltigkeitsmatrix)



Die schädlichsten Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe werden ausgeschlossen. Seit dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Umsätze aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 10\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 10\%$ aus einer Kombination aus dem Kraftwerkskohlebergbau und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

In Sektoren, in denen CO₂-Emissionen einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine CO₂-Emissionen. Dies umfasst eine Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Senkung der Emissionsintensität seines Kerngeschäfts, zur Senkung seines künftigen Energieverbrauchs oder seiner Treibhausgasemissionen (Scope 1, 2 und 3).

In Sektoren, in denen Möglichkeiten im Bereich der erneuerbaren Energien einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf erneuerbare Energien. Hierzu zählt auch die Bewertung der Kapazität eines Unternehmens im Bereich der erneuerbaren Energien.

Im Mai 2020 hat JSS ein Klimaversprechen abgegeben, das auf Klimaneutralität bis zum Jahr 2035 abzielt. Bei Fonds, bei denen dieses Versprechen bereits umgesetzt wurde, werden Treibhausgasemissionen anhand des CO₂-Fußabdrucks überwacht; diese Kontrollen werden für eine Teilmenge der Fonds durchgeführt. Die Einhaltung des Klimaversprechens wird mithilfe rückwärtsgerichteter Dekarbonisierungspfade überprüft, mit denen Übergangsrisiken gemindert werden sollen. Die meisten Fonds, die das Klimaversprechen umgesetzt haben, wenden folgende Methode an: Das ursprüngliche Ziel entspricht einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen des Referenzwerts um 30%. Diese Zielvorgabe wird in den folgenden Jahren um 7% verringert. Ab 2030 wird das Ziel linear gesenkt, bis das Netto-Null-Ziel im Jahr 2035 schließlich erreicht wird. Die THG-Emissionen des Portfolios auf der Grundlage der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro Mio. USD des Unternehmenswertes (EVIC) ausgedrückt.

Tätigkeiten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung wesentliche ESG-Faktoren darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf Biodiversität und Landnutzung. Hierzu zählt auch eine Bewertung der Auswirkungen der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens auf die Biodiversität. Zudem wird Palmöl konsequent ausgeschlossen.

Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Emissionen in Wasser (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Emissionen in Wasser erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Wasserbewirtschaftung. Die Wasserbewirtschaftung umfasst eine Bewertung wassereffizienter Produktionsprozesse, Trends bei der Wasserintensität sowie messbare, zeitlich befristete Zielvorgaben zur Senkung des Wasserverbrauchs. Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Gefährlicher Abfall (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Schadstoffemissionen und schädlichen Abfällen erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Schadstoffemissionen und seine Abfallwirtschaft. Der Umgang mit Schadstoffemissionen umfasst eine Bewertung der Bemühungen zur Kontrolle und Verringerung der Menge giftiger und krebserregender Nebenprodukte im Rahmen der Geschäftstätigkeit, Trends bei der Schadstofffreisetzung sowie messbare, zeitlich begrenzte Zielvorgaben zur Reduzierung von Schadstoffemissionen.

Verstöße gegen UNGC-Grundsätze (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen

nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Fehlende Prozesse zur Überwachung der Einhaltung des UNGC

Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Bestandteil der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Investitionsprozess einbeziehen, sobald die Offenlegungsquoten ausreichend sind. In der Zwischenzeit erfolgt eine ESG-Überwachung, bei der unter anderem regelmäßige Screenings auf Verstöße gegen die UNGC-Vorgaben durchgeführt werden. JSS strebt eine Berücksichtigung dieses Indikators an, sobald sich die Datenzuverlässigkeit und -verfügbarkeit verbessern.

Engagement in umstrittenen Waffen (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS wird seiner Verantwortung in Bezug auf umstrittene Waffen aktiv gerecht, indem es sie konzernweit ausschließt. JSS investiert keine Eigenmittel in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich der umstrittenen Waffen tätig sind. Ferner übernimmt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für solche Unternehmen bzw. keine Dienstleistungen im Zusammenhang mit Kapitalmärkten oder Fusionen und Übernahmen.

Staaten

THG-Emissionsintensität (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die externen Umweltkosten eines Landes. Bewertet werden unter anderem die Treibhausgasemissionen pro Kopf.

Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Landes in Bezug auf Grundrechte.



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:
01.07.2023 – 30.06.2024

Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORP	Information und Kommunikation	6,52	US
ALPHABET INC-CL A	Information und Kommunikation	4,46	US
STANTEC INC	Baugewerbe/Bau	3,74	CA
ARISTA NETWORKS INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,26	US
MOTOROLA SOLUTIONS INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,10	US
CADENCE DESIGN SYS INC	Information und Kommunikation	2,99	US
FLEX LTD	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,91	US
NVIDIA CORP	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,77	US
ASM INTERNATIONAL NV	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,71	NL
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,66	US
ECOLAB INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,62	US
SCHNEIDER ELECTRIC SE	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,52	FR
SHIMANO INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,49	JP
COLGATE-PALMOLIVE CO	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,37	US
AMERIPRISE FINANCIAL INC	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,15	US

Hauptinvestitionen per 30.06.2024 (Ende des Geschäftsjahres). Keine bedeutenden Abweichungen über das Geschäftsjahr.

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.



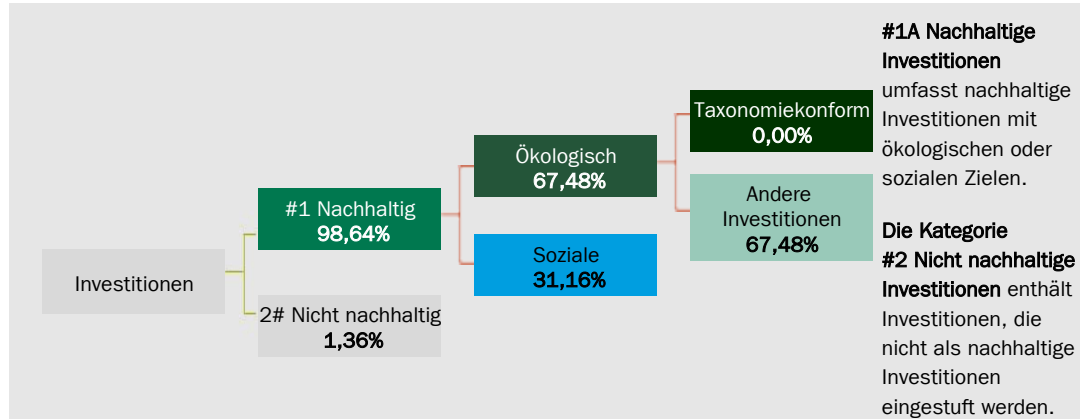
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 98,64%.

67,48% der Investitionen des Finanzprodukts waren ökologisch nachhaltige Investitionen, und 31,16% der Investitionen des Finanzprodukts waren sozial nachhaltige Investitionen. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Nicht nachhaltige Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Bezeichnung des Sektors	Anteil der Investitionen
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	14,85%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von pharmazeutischen Erzeugnissen	10,69%
Information und Kommunikation – Verlegen von sonstiger Software	6,52%
Information und Kommunikation – Verlagswesen	5,98%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von elektronischen Bauelementen	4,55%
Information und Kommunikation – Webportale	4,46%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Mit Finanz- und Versicherungsdienstleistungen verbundene Tätigkeiten (ohne Versicherungen und Pensionskassen)	4,07%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Nichtlebensversicherung	4,06%
Baugewerbe/Bau – Tiefbau	3,74%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,69%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Sonstige Kreditinstitute (ohne Spezialkreditinstitute)	3,57%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Papier, Pappe und Waren daraus	3,48%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von sonstigen Waren	3,37%
Energieversorgung – Elektrizitäts-, Gas-, Wärme- und Kälteversorgung	3,01%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Rückversicherungen	2,66%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Seifen, Wasch- und Reinigungsmitteln	2,62%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von elektrischem Installationsmaterial	2,52%
Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Grundstücks- und Wohnungswesen	2,07%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von kälte- und lufttechnischen Erzeugnissen, nicht für den Haushalt	2,04%
Andere	12,05%

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** enthalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend; dieses Finanzprodukt hat sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel verpflichtet, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert(1)?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

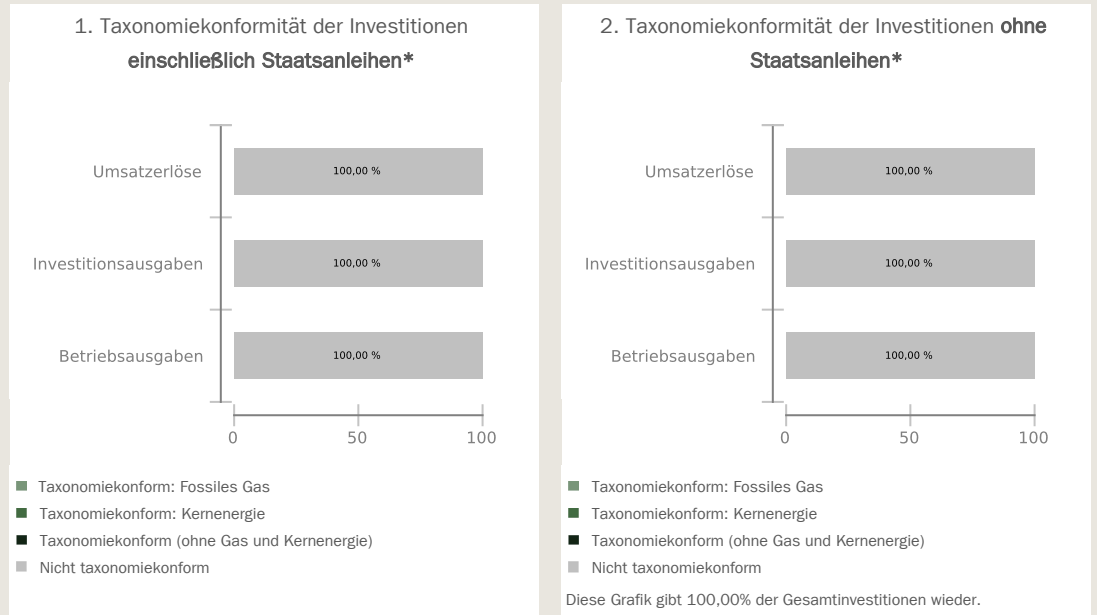
Nein

(1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind: 0,00%

Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind: 0,00%

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen	Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen (J-1)
0,00%	0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.



● **Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?**

Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden: 67,48%

Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein; allerdings ist der Anlageverwalter gegenwärtig nicht in der Lage, den Anteil der zugrundeliegenden Investitionen des Finanzprodukts, berechnet gemäß der EU-Taxonomie, genau anzugeben. Diese Position wird jedoch weiterhin geprüft, während die zugrundeliegenden Regelungen im Laufe der Zeit fertiggestellt und mehr zuverlässige Daten verfügbar werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil nachhaltiger Investitionen mit einem sozialen Ziel: 31,16%

Seit dem 20. Juni 2024 verpflichtet sich dieses Finanzprodukt nicht mehr zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel.

Das Dokument mit den vorvertraglichen Informationen wurde entsprechend aktualisiert.



Welche Investitionen fielen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Nicht nachhaltige Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erreichung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Der Anlageverwalter wendete bei seiner Strategie die folgenden verbindlichen Kriterien an:

(a) Ausschluss von Anlagen in umstrittenen Geschäftsaktivitäten gemäß den Ausschlussrichtlinien von JSS. Zudem wurden folgende Ausschlüsse (mit Umsatzschwellen) angewendet:

- Unkonventionelle Erdöl- und Erdgasförderung: Ölsande und Fracking (Umsatzschwelle: 5%);
- Konventionelle Erdöl- und Erdgasförderung (Umsatzschwelle: 5%);
- Raffination von Erdöl und Erdgas (Umsatzschwelle: 5%);
- Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle (Umsatzschwelle: 5%);
- Stromerzeugung aus Flüssigbrennstoff (Umsatzschwelle: 5%);

Stromerzeugung aus Kernkraft (Umsatzschwelle: 5%);

(b) Minderung von Risiken und Wahrnehmung von Gelegenheiten in Zusammenhang mit ESG. Emittenten mit einem A- oder B-Rating, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig waren, wurden ausgeschlossen, sofern sie nicht über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügten. Emittenten, die voraussichtlich bald ein genehmigtes SBTi-Ziel erhalten, wurden genauso behandelt wie Emittenten, die bereits über ein solches verfügen;

(c) Erreichung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte nur in Emittenten mit einem Rating von A. Investiert wurde entweder in „Umweltchampions“, d. h. in Unternehmen, die eine erhebliche Verringerung der Emissionen durch innovative Lösungen ermöglichen, oder in Unternehmen mit „Umweltverpflichtung“, d. h. Unternehmen, die im Einklang mit dem Pariser Abkommen eine Begrenzung des Temperaturanstiegs auf weniger als 2°C anstreben. Der Anteil grüner Erträge und die Verringerung der Kohlenstoffbilanz dürften sich im Laufe der Zeit verbessern;

(d) Bewusstes Anstreben messbarer positiver Ergebnisse, indem in Emittenten investiert wurde, die nachhaltige Produkte und Dienstleistungen bewerben, gemessen am Anteil des Ertrags des Emittenten, der mit einem der Nachhaltigkeitsziele der Vereinten Nationen konform ist, oder in Emittenten, die gemessen an wesentlichen ökologischen und/oder sozialen Indikatoren operative Spitzenleistungen gegenüber der Vergleichsgruppe erbringen. Außerdem stand der Anlageverwalter im Dialog mit ausgewählten Unternehmen, in die er investiert, um auf eine Verhaltensumstellung auf nachhaltige Praktiken hinzuwirken.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Die Methode zur Berechnung des bestimmten Indexes kann unter <https://www.msci.com/index-methodology> eingesehen werden.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt das nachhaltige Investitionsziel erreicht.

● *Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Der Index wird aus seinem standardmäßigen Parent-Index MSCI World gebildet. Er schließt bestimmte Kategorien von Unternehmen aus, die einen starken Bezug zu fossilen Brennstoffen haben, und reduziert die Kohlenstoffintensität auf Indexebene zunächst im Vergleich zum Parent-Index um die Hälfte (50%) sowie jedes Jahr im Vergleich zur Klimaindex-Intensität des Vorjahres um 7%.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?*

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators für das Produkt	Wert des Nachhaltigkeitsindikators für den Referenzwert
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	100	86
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	0	13
ESG-Rating von JSS: Durchschnittliches Unternehmensrating	Von 0 (gering) bis 5 (hoch)	3,49	3,19
CO2-Fußabdruck	Tonnen CO2 pro investierter Million US-Dollar	9,88	6,96
Durchschnittlicher Anteil von „grünen“ Erträgen am Gesamtertrag	Prozentualer Anteil	31	33
Klimaentwicklung	Grad Celsius	1,78	2,19

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Wertentwicklung des Finanzprodukts	30,88%
Wertentwicklung des Referenzwerts	15,80%

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Wertentwicklung des Finanzprodukts	30,88%
Wertentwicklung des relevanten breiten Marktindex	11,09%

Name des Produkts: JSS Investmentfonds SICAV – JSS Sustainable Equity – Real Estate Global
 Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300Y840CE7K6X4L62

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja		Nein	
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 81,81% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/>		<input type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt integriert umweltbezogene, soziale und die Unternehmensführung betreffende Aspekte („ESG“) in den Investitionsprozess mit dem Ziel, ein überdurchschnittlich gutes ESG-Profil für das gesamte Portfolio gemäß der von J. Safra Sarasin („JSS“) entwickelten Nachhaltigkeitsmatrix zu erreichen.

Das ESG-Rating von JSS bewertet die Emittenten im Verhältnis zu ihrer Vergleichsgruppe und reicht von A für Emittenten, die in die Spitzenklasse eingestuft werden, bis zu D für Emittenten, die ggf. eine umstrittene Geschäftstätigkeit ausüben. Beim nachhaltigen Investieren werden Emittenten, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und bei denen die Wahrscheinlichkeit für erhebliche Beeinträchtigungen daher erhöht ist, mit C (schlechteste Leistung im Branchenvergleich) oder D (wegen umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse von Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, die Kreditratings von Staaten unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien zu analysieren. JSS misst die nachhaltige Wirtschaftsleistung eines Landes nach (i) der Verfügbarkeit von natürlichen Ressourcen und (ii) danach, wie effizient diese eingesetzt werden. Die Nachhaltigkeitsbewertungen von Ländern stellen ein ergänzendes Instrument der finanziellen Analyse ihrer Kreditratings dar.

Folgende Ausschlusskriterien (mit Umsatzschwellen) wurden im Berichtszeitraum auf das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Waffenarten, die angesichts ihrer langfristigen humanitären Folgen und/oder der großen Anzahl ziviler Opfer bei ihrem Einsatz als umstritten

eingestuft werden. Dazu zählen u. a. biologische, chemische und atomare Waffen, Streumunition und Anti-Personenminen (Umsatzschwelle: 0%);

- Verteidigung und Rüstung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und wesentliche Bauteile) sowie Hilfssysteme und Dienstleistungen im Zusammenhang mit Waffen (Waffeneinsatzsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5%);

- Kohle: Unternehmen, die in erheblichem Umfang im Kohlegeschäft tätig sind und zugleich keine solide Strategie für den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft vorweisen können (Umsatzschwelle: 5% für den Kohlebergbau, 10% für die Kohleverstromung sowie 10% für die Summe aus beiden Komponenten);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen zwecks landwirtschaftlicher Nutzung gentechnisch verändern (Umsatzschwelle: 0%);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0%);

- Tabak: Hersteller von Tabakprodukten (Umsatzschwelle: 5%);

- Erwachsenenunterhaltung: Produzenten von Erwachsenenunterhaltung (Umsatzschwelle: 5%);

- Verstöße gegen Menschenrechte und sonstige Prinzipien des Global Compact: Unternehmen, die nach Maßgabe anerkannter internationaler Standards an schweren Verstößen gegen Menschenrechte oder sonstige Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen beteiligt sind (Umsatzschwelle: 0%).

- Palmöl: Unternehmen mit einem Bezug zu Palmöl ohne ausreichende Zertifizierung durch den Roundtable on Sustainable Palm Oil („RSPO“) werden ausgeschlossen (Umsatzschwelle: 5% für Palmölproduzenten, wenn weniger als 75% der Standorte eine RSPO-Zertifizierung besitzen).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Zeitpunkt dar. Bei nachhaltigen Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem sozialen Ziel beitragen, wird davon ausgegangen, dass sie zu beiden gleichermaßen beitragen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● *Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?*

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	100
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	0

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators (J-1)
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	100	100
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	0	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der CO₂-Emissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren Zielen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) in Einklang stehen, oder durch die Einnahme einer Spitzenposition im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren innerhalb der Vergleichsgruppe.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Prüfung auf erhebliche Beeinträchtigungen (Do no significant harm, „DSNH“) schließt Emittenten aus, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellenwerte der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen nicht erreichen. Ein Emittent besteht die Prüfung, wenn er nach der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Bewertung A oder B erhält. Wenn der Emittent im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist, muss er außerdem über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügen, um die Prüfung zu bestehen. Zu den Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen gehören Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie Kraftwerks- und Koks Kohle.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen nach Maßgabe der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen im Rahmen des Investitionsprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten negativen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Investitionen erreicht, die die ökologischen oder sozialen Mindestschwellenwerte nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Mitwirkungsmaßnahmen dienen der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Die Definition des ESG-Auswahlverfahrens und Anlageuniversums beruht auf den

Richtlinien und der Strategie von JSS für nachhaltiges Investieren, in denen die Prinzipien mehrerer internationaler Übereinkommen und Normen enthalten sind, u. a.:

Die Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen,

Die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

Der Global Compact der Vereinten Nationen,

Die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

Die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

Die Grundsätze zu Kinderrechten und unternehmerischem Handeln,

Die Arbeitsstandards der ILO,

Die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

Das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

Das Übereinkommen über Streumunition.

Der ESG-Auswahlprozess trägt dazu bei, börsennotierte Unternehmen zu ermitteln, die vermeintlich gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung verstoßen, wie in den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte vorgesehen. Diese Unternehmen werden als unvereinbar mit den o. a. Prinzipien erachtet und aus dem Universum nachhaltiger Investitionen von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Unternehmen

THG-Emissionen, CO₂-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind, Anteil des Verbrauchs und der Erzeugung von nicht erneuerbaren Energien, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (berücksichtigt für Ausschlüsse, Klimaversprechen und innerhalb der Nachhaltigkeitsmatrix)

Die schädlichsten Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe werden ausgeschlossen. Seit dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Umsätze aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 10\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 10\%$ aus einer Kombination aus dem Kraftwerkskohlebergbau und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

In Sektoren, in denen CO₂-Emissionen einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine CO₂-Emissionen. Dies umfasst eine Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Senkung der Emissionsintensität seines Kerngeschäfts, zur Senkung seines künftigen Energieverbrauchs oder seiner Treibhausgasemissionen (Scope 1, 2 und 3).

In Sektoren, in denen Möglichkeiten im Bereich der erneuerbaren Energien einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf erneuerbare Energien. Hierzu zählt auch die Bewertung der Kapazität eines Unternehmens im Bereich der erneuerbaren Energien.

Im Mai 2020 hat JSS ein Klimaversprechen abgegeben, das auf Klimaneutralität bis zum Jahr 2035 abzielt. Bei Fonds, bei denen dieses Versprechen bereits umgesetzt wurde, werden Treibhausgasemissionen anhand des CO₂-Fußabdrucks überwacht; diese Kontrollen werden für eine Teilmenge der Fonds durchgeführt. Die Einhaltung des Klimaversprechens wird mithilfe rückwärtsgerichteter Dekarbonisierungspfade überprüft, mit denen Übergangsrisiken gemindert werden sollen. Die meisten Fonds, die das Klimaversprechen umgesetzt haben, wenden folgende Methode an: Das ursprüngliche Ziel entspricht einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen des Referenzwerts um 30%. Diese Zielvorgabe wird in den folgenden Jahren um 7% verringert. Ab 2030 wird das Ziel linear gesenkt, bis das Netto-Null-Ziel im Jahr 2035 schließlich erreicht wird. Die THG-Emissionen des Portfolios auf der Grundlage der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro Mio. USD des Unternehmenswertes (EVIC) ausgedrückt.

Tätigkeiten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung wesentliche ESG-Faktoren darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf Biodiversität und Landnutzung. Hierzu zählt auch eine Bewertung der Auswirkungen der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens auf die Biodiversität. Zudem wird Palmöl konsequent ausgeschlossen.

Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Emissionen in Wasser (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Emissionen in Wasser erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Wasserbewirtschaftung. Die Wasserbewirtschaftung umfasst eine Bewertung wassereffizienter Produktionsprozesse, Trends bei der Wasserintensität sowie messbare, zeitlich befristete Zielvorgaben zur Senkung des Wasserverbrauchs. Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Gefährlicher Abfall (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Schadstoffemissionen und schädlichen Abfällen erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Schadstoffemissionen und seine Abfallwirtschaft. Der Umgang mit Schadstoffemissionen umfasst eine Bewertung der Bemühungen zur Kontrolle und Verringerung der Menge giftiger und krebserregender Nebenprodukte im Rahmen der Geschäftstätigkeit, Trends bei der Schadstofffreisetzung sowie messbare, zeitlich begrenzte Zielvorgaben zur Reduzierung von Schadstoffemissionen.

Verstöße gegen UNGC-Grundsätze (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Fehlende Prozesse zur Überwachung der Einhaltung des UNGC

Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Bestandteil der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Investitionsprozess einbeziehen, sobald die Offenlegungsquoten ausreichend

sind. In der Zwischenzeit erfolgt eine ESG-Überwachung, bei der unter anderem regelmäßige Screenings auf Verstöße gegen die UNGC-Vorgaben durchgeführt werden. JSS strebt eine Berücksichtigung dieses Indikators an, sobald sich die Datenzuverlässigkeit und -verfügbarkeit verbessern.

Engagement in umstrittenen Waffen (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS wird seiner Verantwortung in Bezug auf umstrittene Waffen aktiv gerecht, indem es sie konzernweit ausschließt. JSS investiert keine Eigenmittel in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich der umstrittenen Waffen tätig sind. Ferner übernimmt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für solche Unternehmen bzw. keine Dienstleistungen im Zusammenhang mit Kapitalmärkten oder Fusionen und Übernahmen.

Staaten

THG-Emissionsintensität (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die externen Umweltkosten eines Landes. Bewertet werden unter anderem die Treibhausgasemissionen pro Kopf.

Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Landes in Bezug auf Grundrechte.



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 – 30.06.2024

Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
PROLOGIS INC	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	9,14	US
VONOVIA SE	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	5,21	DE
CTP NV	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	4,81	NL
MITSUI FUDOSAN CO LTD	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	4,77	JP
LEG IMMOBILIEN SE	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	4,76	DE
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	4,13	US
MITSUBISHI ESTATE CO LTD	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	3,95	JP
DERWENT LONDON PLC	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	3,73	GB
SEGRO PLC	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	3,71	GB
EQUITY RESIDENTIAL	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	3,38	US
NIPPON PROLOGIS REIT INC	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	3,26	JP

Hauptinvestitionen per 30.06.2024 (Ende des Geschäftsjahres). Keine bedeutenden Abweichungen über das Geschäftsjahr.

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.



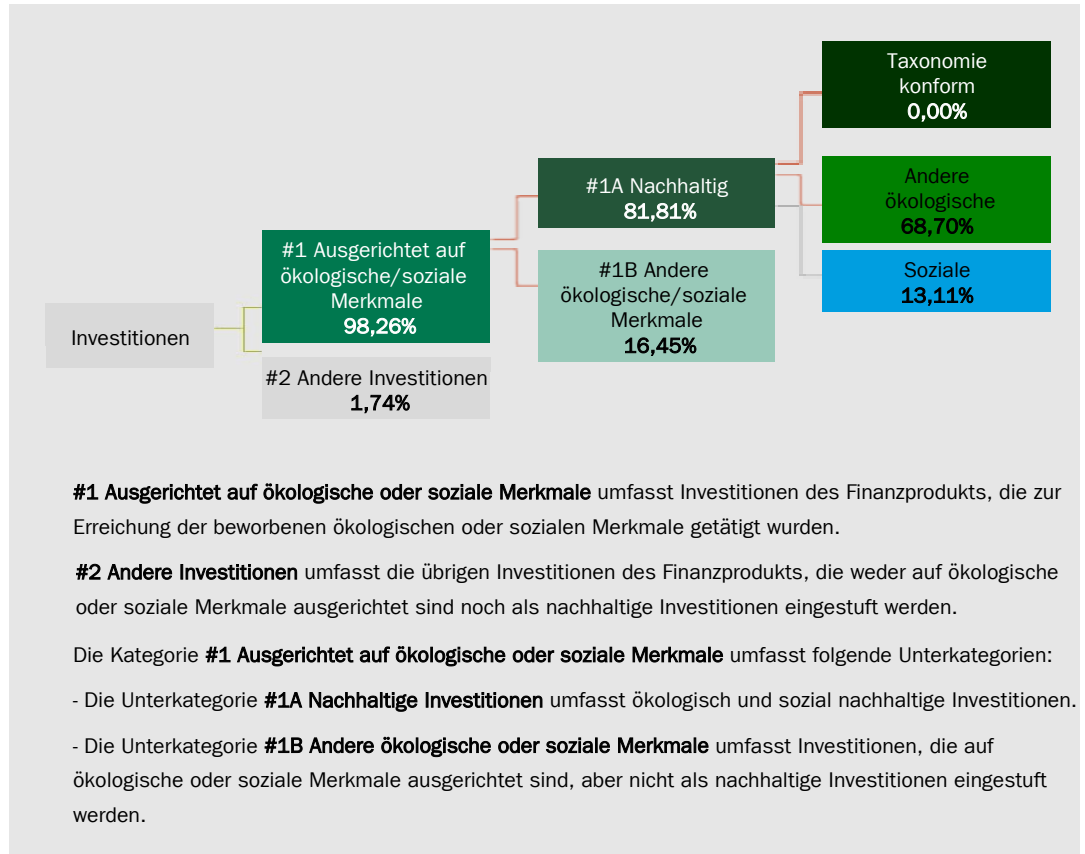
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 81,81%.

68,7% der Investitionen des Finanzprodukts waren ökologisch nachhaltige Investitionen, und 13,11% der Investitionen des Finanzprodukts waren sozial nachhaltige Investitionen. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

● **Wie sah die Vermögensallokation aus?**

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Bezeichnung des Sektors	Anteil der Investitionen
Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Grundstücks- und Wohnungswesen	85,32%
Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Vermietung, Verpachtung von eigenen oder geleasteten Grundstücken, Gebäuden und Wohnungen	10,02%
Information und Kommunikation – Erbringung von Beratungsleistungen auf dem Gebiet der Informationstechnologie	3,13%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Fondsmanagement	1,53%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Sonstige Finanzdienstleistungen außer Versicherungen und Pensionskassen (nicht anderweitig erfasst)	0,00%

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** enthalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend; dieses Finanzprodukt hat sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel verpflichtet, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert(1)?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

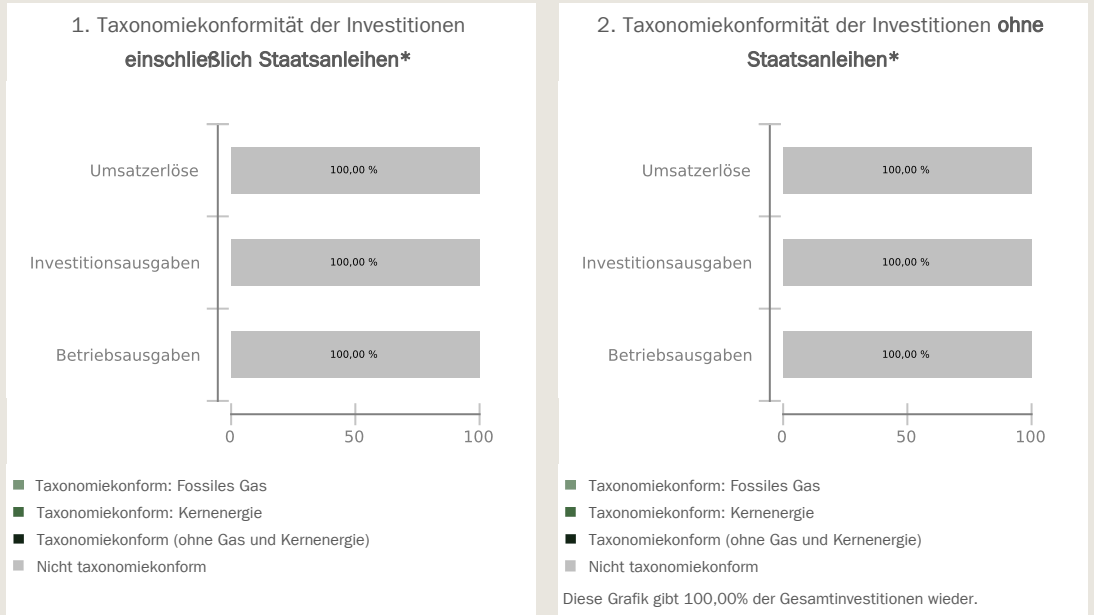
Nein

(1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind: 0,00%

Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind: 0,00%

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen	Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen (J-1)
0,00%	0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden: 68,70%

Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein; allerdings ist der Anlageverwalter gegenwärtig nicht in der Lage, den Anteil der zugrundeliegenden Investitionen des Finanzprodukts, berechnet gemäß der EU-Taxonomie, genau anzugeben. Diese Position wird jedoch weiterhin geprüft, während die zugrundeliegenden Regelungen im Laufe der Zeit fertiggestellt und mehr zuverlässige Daten verfügbar werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen: 13,11%



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts folgte einem rigorosen Verfahren, bei dem durchgängig ESG-Aspekte berücksichtigt wurden. Der Anlageverwalter wendete bei seiner Strategie die folgenden verbindlichen Kriterien an:

- (a) Ausschluss von Anlagen in umstrittenen Geschäftsaktivitäten gemäß den Ausschlussrichtlinien von JSS;
- (b) Erreichung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte nicht in mit C oder D bewertete Emittenten.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Name des Produkts: JSS Investmentfonds SICAV – JSS Sustainable Equity – USA
 Unternehmenskennung (LEI-Code): 5493003LS78C3WGH5Z33

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : __% <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 91,09% an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt integriert umweltbezogene, soziale und die Unternehmensführung betreffende Aspekte („ESG“) in den Investitionsprozess mit dem Ziel, ein überdurchschnittlich gutes ESG-Profil für das gesamte Portfolio gemäß der von J. Safra Sarasin („JSS“) entwickelten Nachhaltigkeitsmatrix zu erreichen.

Das ESG-Rating von JSS bewertet die Emittenten im Verhältnis zu ihrer Vergleichsgruppe und reicht von A für Emittenten, die in die Spitzenklasse eingestuft werden, bis zu D für Emittenten, die ggf. eine umstrittene Geschäftstätigkeit ausüben. Beim nachhaltigen Investieren werden Emittenten, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und bei denen die Wahrscheinlichkeit für erhebliche Beeinträchtigungen daher erhöht ist, mit C (schlechteste Leistung im Branchenvergleich) oder D (wegen umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse von Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, die Kreditratings von Staaten unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien zu analysieren. JSS misst die nachhaltige Wirtschaftsleistung eines Landes nach (i) der Verfügbarkeit von natürlichen Ressourcen und (ii) danach, wie effizient diese eingesetzt werden. Die Nachhaltigkeitsbewertungen von Ländern stellen ein ergänzendes Instrument der finanziellen Analyse ihrer Kreditratings dar.

Folgende Ausschlusskriterien (mit Umsatzschwellen) wurden im Berichtszeitraum auf das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Waffenarten, die angesichts ihrer langfristigen humanitären Folgen und/oder der großen Anzahl ziviler Opfer bei ihrem Einsatz als umstritten

eingestuft werden. Dazu zählen u. a. biologische, chemische und atomare Waffen, Streumunition und Anti-Personenminen (Umsatzschwelle: 0%);

- Verteidigung und Rüstung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und wesentliche Bauteile) sowie Hilfssysteme und Dienstleistungen im Zusammenhang mit Waffen (Waffeneinsatzsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5%);

- Kohle: Unternehmen, die in erheblichem Umfang im Kohlegeschäft tätig sind und zugleich keine solide Strategie für den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft vorweisen können (Umsatzschwelle: 5% für den Kohlebergbau, 10% für die Kohleverstromung sowie 10% für die Summe aus beiden Komponenten);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen zwecks landwirtschaftlicher Nutzung gentechnisch verändern (Umsatzschwelle: 0%);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0%);

- Tabak: Hersteller von Tabakprodukten (Umsatzschwelle: 5%);

- Erwachsenenunterhaltung: Produzenten von Erwachsenenunterhaltung (Umsatzschwelle: 5%);

- Verstöße gegen Menschenrechte und sonstige Prinzipien des Global Compact: Unternehmen, die nach Maßgabe anerkannter internationaler Standards an schweren Verstößen gegen Menschenrechte oder sonstige Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen beteiligt sind (Umsatzschwelle: 0%).

- Palmöl: Unternehmen mit einem Bezug zu Palmöl ohne ausreichende Zertifizierung durch den Roundtable on Sustainable Palm Oil („RSPO“) werden ausgeschlossen (Umsatzschwelle: 5% für Palmölproduzenten, wenn weniger als 75% der Standorte eine RSPO-Zertifizierung besitzen).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Zeitpunkt dar. Bei nachhaltigen Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem sozialen Ziel beitragen, wird davon ausgegangen, dass sie zu beiden gleichermaßen beitragen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● *Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?*

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	99
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	1

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators (J-1)
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	99	100
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	1	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der CO₂-Emissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren Zielen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) in Einklang stehen, oder durch die Einnahme einer Spitzenposition im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren innerhalb der Vergleichsgruppe.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Prüfung auf erhebliche Beeinträchtigungen (Do no significant harm, „DSNH“) schließt Emittenten aus, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellenwerte der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen nicht erreichen. Ein Emittent besteht die Prüfung, wenn er nach der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Bewertung A oder B erhält. Wenn der Emittent im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist, muss er außerdem über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügen, um die Prüfung zu bestehen. Zu den Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen gehören Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie Kraftwerks- und Koks Kohle.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen nach Maßgabe der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen im Rahmen des Investitionsprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten negativen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Investitionen erreicht, die die ökologischen oder sozialen Mindestschwellenwerte nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Mitwirkungsmaßnahmen dienen der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Die Definition des ESG-Auswahlverfahrens und Anlageuniversums beruht auf den

Richtlinien und der Strategie von JSS für nachhaltiges Investieren, in denen die Prinzipien mehrerer internationaler Übereinkommen und Normen enthalten sind, u. a.:

Die Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen,

Die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

Der Global Compact der Vereinten Nationen,

Die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

Die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

Die Grundsätze zu Kinderrechten und unternehmerischem Handeln,

Die Arbeitsstandards der ILO,

Die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

Das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

Das Übereinkommen über Streumunition.

Der ESG-Auswahlprozess trägt dazu bei, börsennotierte Unternehmen zu ermitteln, die vermeintlich gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung verstoßen, wie in den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte vorgesehen. Diese Unternehmen werden als unvereinbar mit den o. a. Prinzipien erachtet und aus dem Universum nachhaltiger Investitionen von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Unternehmen

THG-Emissionen, CO₂-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind, Anteil des Verbrauchs und der Erzeugung von nicht erneuerbaren Energien, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (berücksichtigt für Ausschlüsse, Klimaversprechen und innerhalb der Nachhaltigkeitsmatrix)

Die schädlichsten Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe werden ausgeschlossen. Seit dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Umsätze aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 10\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 10\%$ aus einer Kombination aus dem Kraftwerkskohlebergbau und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

In Sektoren, in denen CO₂-Emissionen einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine CO₂-Emissionen. Dies umfasst eine Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Senkung der Emissionsintensität seines Kerngeschäfts, zur Senkung seines künftigen Energieverbrauchs oder seiner Treibhausgasemissionen (Scope 1, 2 und 3).

In Sektoren, in denen Möglichkeiten im Bereich der erneuerbaren Energien einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf erneuerbare Energien. Hierzu zählt auch die Bewertung der Kapazität eines Unternehmens im Bereich der erneuerbaren Energien.

Im Mai 2020 hat JSS ein Klimaversprechen abgegeben, das auf Klimaneutralität bis zum Jahr 2035 abzielt. Bei Fonds, bei denen dieses Versprechen bereits umgesetzt wurde, werden Treibhausgasemissionen anhand des CO₂-Fußabdrucks überwacht; diese Kontrollen werden für eine Teilmenge der Fonds durchgeführt. Die Einhaltung des Klimaversprechens wird mithilfe rückwärtsgerichteter Dekarbonisierungspfade überprüft, mit denen Übergangsrisiken gemindert werden sollen. Die meisten Fonds, die das Klimaversprechen umgesetzt haben, wenden folgende Methode an: Das ursprüngliche Ziel entspricht einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen des Referenzwerts um 30%. Diese Zielvorgabe wird in den folgenden Jahren um 7% verringert. Ab 2030 wird das Ziel linear gesenkt, bis das Netto-Null-Ziel im Jahr 2035 schließlich erreicht wird. Die THG-Emissionen des Portfolios auf der Grundlage der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro Mio. USD des Unternehmenswertes (EVIC) ausgedrückt.

Tätigkeiten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung wesentliche ESG-Faktoren darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf Biodiversität und Landnutzung. Hierzu zählt auch eine Bewertung der Auswirkungen der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens auf die Biodiversität. Zudem wird Palmöl konsequent ausgeschlossen.

Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Emissionen in Wasser (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Emissionen in Wasser erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Wasserbewirtschaftung. Die Wasserbewirtschaftung umfasst eine Bewertung wassereffizienter Produktionsprozesse, Trends bei der Wasserintensität sowie messbare, zeitlich befristete Zielvorgaben zur Senkung des Wasserverbrauchs. Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Gefährlicher Abfall (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Schadstoffemissionen und schädlichen Abfällen erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Schadstoffemissionen und seine Abfallwirtschaft. Der Umgang mit Schadstoffemissionen umfasst eine Bewertung der Bemühungen zur Kontrolle und Verringerung der Menge giftiger und krebserregender Nebenprodukte im Rahmen der Geschäftstätigkeit, Trends bei der Schadstofffreisetzung sowie messbare, zeitlich begrenzte Zielvorgaben zur Reduzierung von Schadstoffemissionen.

Verstöße gegen UNGC-Grundsätze (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Fehlende Prozesse zur Überwachung der Einhaltung des UNGC

Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Bestandteil der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Investitionsprozess einbeziehen, sobald die Offenlegungsquoten ausreichend

sind. In der Zwischenzeit erfolgt eine ESG-Überwachung, bei der unter anderem regelmäßige Screenings auf Verstöße gegen die UNGC-Vorgaben durchgeführt werden. JSS strebt eine Berücksichtigung dieses Indikators an, sobald sich die Datenzuverlässigkeit und -verfügbarkeit verbessern.

Engagement in umstrittenen Waffen (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS wird seiner Verantwortung in Bezug auf umstrittene Waffen aktiv gerecht, indem es sie konzernweit ausschließt. JSS investiert keine Eigenmittel in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich der umstrittenen Waffen tätig sind. Ferner übernimmt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für solche Unternehmen bzw. keine Dienstleistungen im Zusammenhang mit Kapitalmärkten oder Fusionen und Übernahmen.

Staaten

THG-Emissionsintensität (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die externen Umweltkosten eines Landes. Bewertet werden unter anderem die Treibhausgasemissionen pro Kopf.

Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Landes in Bezug auf Grundrechte.



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 – 30.06.2024

Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORP	Information und Kommunikation	8,60	US
AMAZON.COM INC	Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	5,50	US
APPLE INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,59	US
ALPHABET INC-CL C	Information und Kommunikation	4,24	US
NVIDIA CORP	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,19	US
APPLIED MATERIALS INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,96	US
CADENCE DESIGN SYS INC	Information und Kommunikation	3,75	US
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	3,43	US
ARISTA NETWORKS INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,13	US
ELI LILLY & CO	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,87	US
FLEX LTD	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,75	US
MOTOROLA SOLUTIONS INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,71	US
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,65	US

Hauptinvestitionen per 30.06.2024 (Ende des Geschäftsjahres). Keine bedeutenden Abweichungen über das Geschäftsjahr.

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

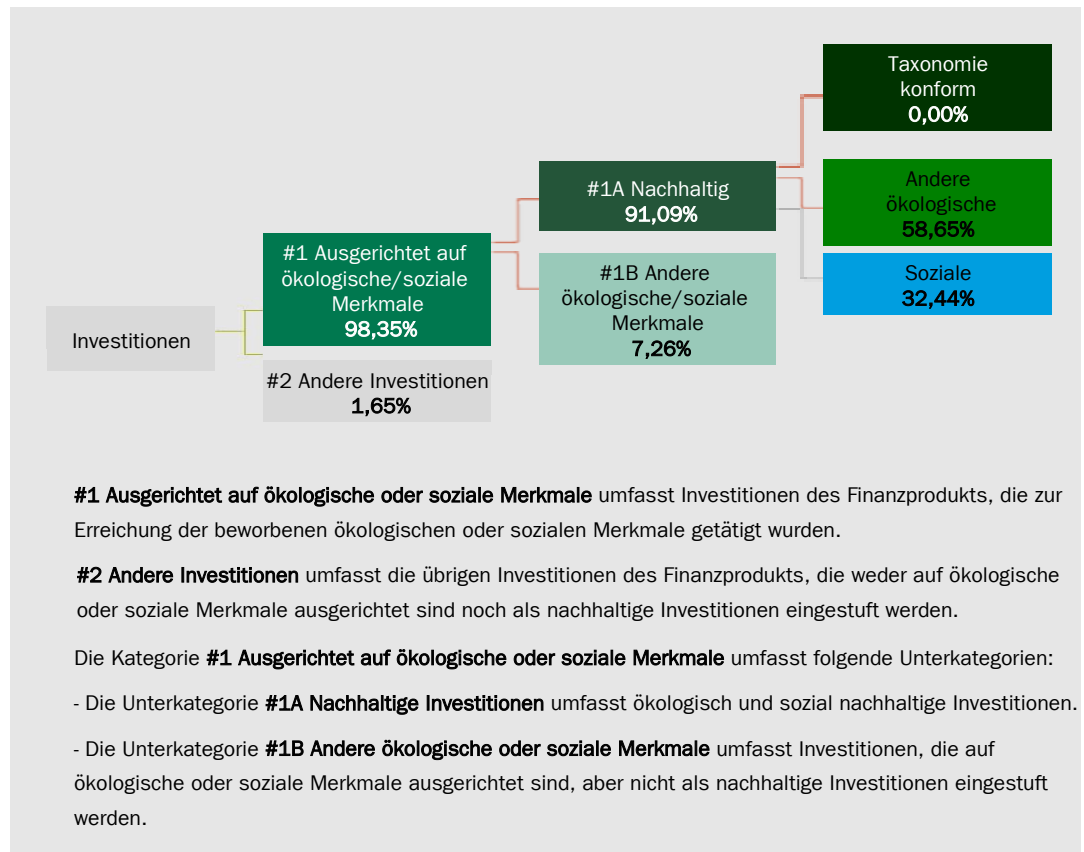


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 91,09%. 58,65% der Investitionen des Finanzprodukts waren ökologisch nachhaltige Investitionen, und 32,44% der Investitionen des Finanzprodukts waren sozial nachhaltige Investitionen. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Bezeichnung des Sektors	Anteil der Investitionen
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	14,01%
Information und Kommunikation – Verlegen von sonstiger Software	8,60%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von pharmazeutischen Erzeugnissen	7,90%
Information und Kommunikation – Verlagswesen	6,66%
Handel mit Kraftfahrzeugen; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen – Versand- und Internet-Einzelhandel	5,50%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Geräten und Einrichtungen der Telekommunikationstechnik	4,59%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Mit Finanz- und Versicherungsdienstleistungen verbundene Tätigkeiten (ohne Versicherungen und Pensionskassen)	4,26%
Information und Kommunikation – Webportale	4,24%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von elektronischen Bauelementen	4,19%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,62%
Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden – Gewinnung von Erdöl und Erdgas	3,43%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Nichtlebensversicherung	3,26%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Rückversicherungen	2,65%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Papier, Pappe und Waren daraus	2,51%
Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen – Erbringung sonstiger Reservierungsdienstleistungen	2,50%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von sonstigen Erzeugnissen aus nichtmetallischen Mineralien a. n. g.	2,47%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Sonstige Kreditinstitute (ohne Spezialkreditinstitute)	2,43%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Kälte- und Lufttechnischen Erzeugnissen, nicht für den Haushalt	2,13%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Erfrischungsgetränken; Gewinnung natürlicher Mineralwässer	2,11%
Andere	12,94%

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** enthalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend; dieses Finanzprodukt hat sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel verpflichtet, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert(1)?**

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

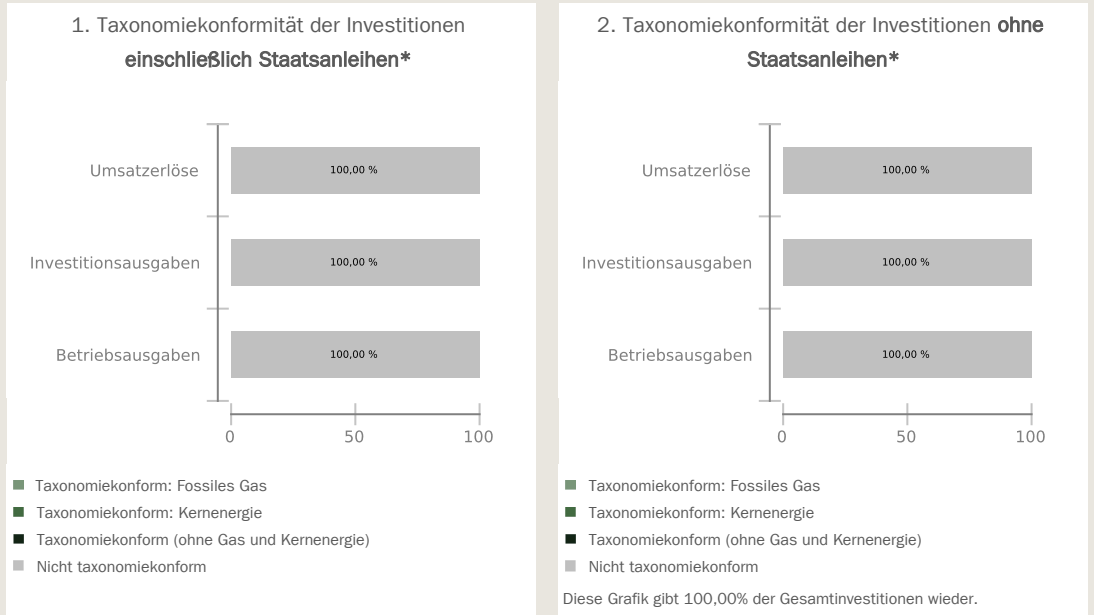
Nein

(1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind: 0,00%

Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind: 0,00%

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen	Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen (J-1)
0,00%	0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden: 58,65%

Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein; allerdings ist der Anlageverwalter gegenwärtig nicht in der Lage, den Anteil der zugrundeliegenden Investitionen des Finanzprodukts, berechnet gemäß der EU-Taxonomie, genau anzugeben. Diese Position wird jedoch weiterhin geprüft, während die zugrundeliegenden Regelungen im Laufe der Zeit fertiggestellt und mehr zuverlässige Daten verfügbar werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen: 32,44%



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts folgte einem rigorosen Verfahren, bei dem durchgängig ESG-Aspekte berücksichtigt wurden. Der Anlageverwalter wendete bei seiner Strategie die folgenden verbindlichen Kriterien an:

- (a) Ausschluss von Anlagen in umstrittenen Geschäftsaktivitäten gemäß den Ausschlussrichtlinien von JSS;
- (b) Erreichung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte nicht in mit C oder D bewertete Emittenten.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Name des Produkts: JSS Investmentfonds SICAV – JSS Sustainable Multi Asset – Global Opportunities
 Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300TS1TXQUMDN1071

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 60,48% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt integriert umweltbezogene, soziale und die Unternehmensführung betreffende Aspekte („ESG“) in den Investitionsprozess mit dem Ziel, ein überdurchschnittlich gutes ESG-Profil für das gesamte Portfolio gemäß der von J. Safra Sarasin („JSS“) entwickelten Nachhaltigkeitsmatrix zu erreichen.

Das ESG-Rating von JSS bewertet die Emittenten im Verhältnis zu ihrer Vergleichsgruppe und reicht von A für Emittenten, die in die Spitzenklasse eingestuft werden, bis zu D für Emittenten, die ggf. eine umstrittene Geschäftstätigkeit ausüben. Beim nachhaltigen Investieren werden Emittenten, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und bei denen die Wahrscheinlichkeit für erhebliche Beeinträchtigungen daher erhöht ist, mit C (schlechteste Leistung im Branchenvergleich) oder D (wegen umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse von Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, die Kreditratings von Staaten unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien zu analysieren. JSS misst die nachhaltige Wirtschaftsleistung eines Landes nach (i) der Verfügbarkeit von natürlichen Ressourcen und (ii) danach, wie effizient diese eingesetzt werden. Die Nachhaltigkeitsbewertungen von Ländern stellen ein ergänzendes Instrument der finanziellen Analyse ihrer Kreditratings dar.

Folgende Ausschlusskriterien (mit Umsatzschwellen) wurden im Berichtszeitraum auf das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Waffenarten, die angesichts ihrer langfristigen humanitären Folgen und/oder der großen Anzahl ziviler Opfer bei ihrem Einsatz als umstritten

eingestuft werden. Dazu zählen u. a. biologische, chemische und atomare Waffen, Streumunition und Anti-Personenminen (Umsatzschwelle: 0%);

- Verteidigung und Rüstung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und wesentliche Bauteile) sowie Hilfssysteme und Dienstleistungen im Zusammenhang mit Waffen (Waffeneinsatzsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5%);

- Kohle: Unternehmen, die in erheblichem Umfang im Kohlegeschäft tätig sind und zugleich keine solide Strategie für den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft vorweisen können (Umsatzschwelle: 5% für den Kohlebergbau, 10% für die Kohleverstromung sowie 10% für die Summe aus beiden Komponenten);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen zwecks landwirtschaftlicher Nutzung gentechnisch verändern (Umsatzschwelle: 0%);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0%);

- Tabak: Hersteller von Tabakprodukten (Umsatzschwelle: 5%);

- Erwachsenenunterhaltung: Produzenten von Erwachsenenunterhaltung (Umsatzschwelle: 5%);

- Verstöße gegen Menschenrechte und sonstige Prinzipien des Global Compact: Unternehmen, die nach Maßgabe anerkannter internationaler Standards an schweren Verstößen gegen Menschenrechte oder sonstige Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen beteiligt sind (Umsatzschwelle: 0%).

- Palmöl: Unternehmen mit einem Bezug zu Palmöl ohne ausreichende Zertifizierung durch den Roundtable on Sustainable Palm Oil („RSPO“) werden ausgeschlossen (Umsatzschwelle: 5% für Palmölproduzenten, wenn weniger als 75% der Standorte eine RSPO-Zertifizierung besitzen).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Zeitpunkt dar. Bei nachhaltigen Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem sozialen Ziel beitragen, wird davon ausgegangen, dass sie zu beiden gleichermaßen beitragen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● *Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?*

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	100
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	0

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators (J-1)
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	100	100
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	0	0

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der CO₂-Emissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren Zielen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) in Einklang stehen, oder durch die Einnahme einer Spitzenposition im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren innerhalb der Vergleichsgruppe.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Prüfung auf erhebliche Beeinträchtigungen (Do no significant harm, „DSNH“) schließt Emittenten aus, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellenwerte der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen nicht erreichen. Ein Emittent besteht die Prüfung, wenn er nach der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Bewertung A oder B erhält. Wenn der Emittent im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist, muss er außerdem über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügen, um die Prüfung zu bestehen. Zu den Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen gehören Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie Kraftwerks- und Koks Kohle.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen nach Maßgabe der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen im Rahmen des Investitionsprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten negativen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Investitionen erreicht, die die ökologischen oder sozialen Mindestschwellenwerte nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Mitwirkungsmaßnahmen dienen der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Die Definition des ESG-Auswahlverfahrens und Anlageuniversums beruht auf den

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Richtlinien und der Strategie von JSS für nachhaltiges Investieren, in denen die Prinzipien mehrerer internationaler Übereinkommen und Normen enthalten sind, u. a.:

Die Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen,

Die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

Der Global Compact der Vereinten Nationen,

Die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

Die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

Die Grundsätze zu Kinderrechten und unternehmerischem Handeln,

Die Arbeitsstandards der ILO,

Die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

Das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

Das Übereinkommen über Streumunition.

Der ESG-Auswahlprozess trägt dazu bei, börsennotierte Unternehmen zu ermitteln, die vermeintlich gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung verstoßen, wie in den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte vorgesehen. Diese Unternehmen werden als unvereinbar mit den o. a. Prinzipien erachtet und aus dem Universum nachhaltiger Investitionen von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Unternehmen

THG-Emissionen, CO₂-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind, Anteil des Verbrauchs und der Erzeugung von nicht erneuerbaren Energien, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (berücksichtigt für Ausschlüsse, Klimaversprechen und innerhalb der Nachhaltigkeitsmatrix)

Die schädlichsten Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe werden ausgeschlossen. Seit dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Umsätze aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 10\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 10\%$ aus einer Kombination aus dem Kraftwerkskohlebergbau und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

In Sektoren, in denen CO₂-Emissionen einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine CO₂-Emissionen. Dies umfasst eine Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Senkung der Emissionsintensität seines Kerngeschäfts, zur Senkung seines künftigen Energieverbrauchs oder seiner Treibhausgasemissionen (Scope 1, 2 und 3).

In Sektoren, in denen Möglichkeiten im Bereich der erneuerbaren Energien einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf erneuerbare Energien. Hierzu zählt auch die Bewertung der Kapazität eines Unternehmens im Bereich der erneuerbaren Energien.

Im Mai 2020 hat JSS ein Klimaversprechen abgegeben, das auf Klimaneutralität bis zum Jahr 2035 abzielt. Bei Fonds, bei denen dieses Versprechen bereits umgesetzt wurde, werden Treibhausgasemissionen anhand des CO₂-Fußabdrucks überwacht; diese Kontrollen werden für eine Teilmenge der Fonds durchgeführt. Die Einhaltung des Klimaversprechens wird mithilfe rückwärtsgerichteter Dekarbonisierungspfade überprüft, mit denen Übergangsrisiken gemindert werden sollen. Die meisten Fonds, die das Klimaversprechen umgesetzt haben, wenden folgende Methode an: Das ursprüngliche Ziel entspricht einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen des Referenzwerts um 30%. Diese Zielvorgabe wird in den folgenden Jahren um 7% verringert. Ab 2030 wird das Ziel linear gesenkt, bis das Netto-Null-Ziel im Jahr 2035 schließlich erreicht wird. Die THG-Emissionen des Portfolios auf der Grundlage der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro Mio. USD des Unternehmenswertes (EVIC) ausgedrückt.

Tätigkeiten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung wesentliche ESG-Faktoren darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf Biodiversität und Landnutzung. Hierzu zählt auch eine Bewertung der Auswirkungen der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens auf die Biodiversität. Zudem wird Palmöl konsequent ausgeschlossen.

Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Emissionen in Wasser (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Emissionen in Wasser erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Wasserbewirtschaftung. Die Wasserbewirtschaftung umfasst eine Bewertung wassereffizienter Produktionsprozesse, Trends bei der Wasserintensität sowie messbare, zeitlich befristete Zielvorgaben zur Senkung des Wasserverbrauchs. Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Gefährlicher Abfall (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Schadstoffemissionen und schädlichen Abfällen erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Schadstoffemissionen und seine Abfallwirtschaft. Der Umgang mit Schadstoffemissionen umfasst eine Bewertung der Bemühungen zur Kontrolle und Verringerung der Menge giftiger und krebserregender Nebenprodukte im Rahmen der Geschäftstätigkeit, Trends bei der Schadstofffreisetzung sowie messbare, zeitlich begrenzte Zielvorgaben zur Reduzierung von Schadstoffemissionen.

Verstöße gegen UNGC-Grundsätze (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Fehlende Prozesse zur Überwachung der Einhaltung des UNGC

Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Bestandteil der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Investitionsprozess einbeziehen, sobald die Offenlegungsquoten ausreichend

sind. In der Zwischenzeit erfolgt eine ESG-Überwachung, bei der unter anderem regelmäßige Screenings auf Verstöße gegen die UNGC-Vorgaben durchgeführt werden. JSS strebt eine Berücksichtigung dieses Indikators an, sobald sich die Datenzuverlässigkeit und -verfügbarkeit verbessern.

Engagement in umstrittenen Waffen (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS wird seiner Verantwortung in Bezug auf umstrittene Waffen aktiv gerecht, indem es sie konzernweit ausschließt. JSS investiert keine Eigenmittel in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich der umstrittenen Waffen tätig sind. Ferner übernimmt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für solche Unternehmen bzw. keine Dienstleistungen im Zusammenhang mit Kapitalmärkten oder Fusionen und Übernahmen.

Staaten

THG-Emissionsintensität (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die externen Umweltkosten eines Landes. Bewertet werden unter anderem die Treibhausgasemissionen pro Kopf.

Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Landes in Bezug auf Grundrechte.



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 – 30.06.2024

Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
REGIERUNG AUSTRALIENS	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	3,90	AU
JSS SUSTAIN-SYS EM-H USD ACC	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	3,28	LU
SK HYNIX INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,59	KR
RAIFFEISEN BANK INTL	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,53	AT
LB BADEN-WUERTTEMBERG	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,53	DE
REC LTD	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,53	IN
INFRASTRUCTURA ENERGETI	Energieversorgung	0,52	MX
ABU DHABI COMMERCIAL BNK	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,52	AE
ITV PLC	Information und Kommunikation	0,52	GB
VOLKSBANK WIEN AG	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,51	AT
CGI INC	Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	0,51	CA
HAITONG INTL SECURITIES	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,51	BM
BPCE SA	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	0,50	FR
TELEPERFORMANCE	Information und Kommunikation	0,50	FR
TD SYNEX CORP	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	0,50	US

Hauptinvestitionen per 30.06.2024 (Ende des Geschäftsjahres). Keine bedeutenden Abweichungen über das Geschäftsjahr.

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Die Gewichtung von Anleihen wird ermittelt, indem der Marktpreis der Anleihe (einschließlich aufgelaufener Zinsen) durch das Gesamtvermögen des Teilfonds geteilt wird.



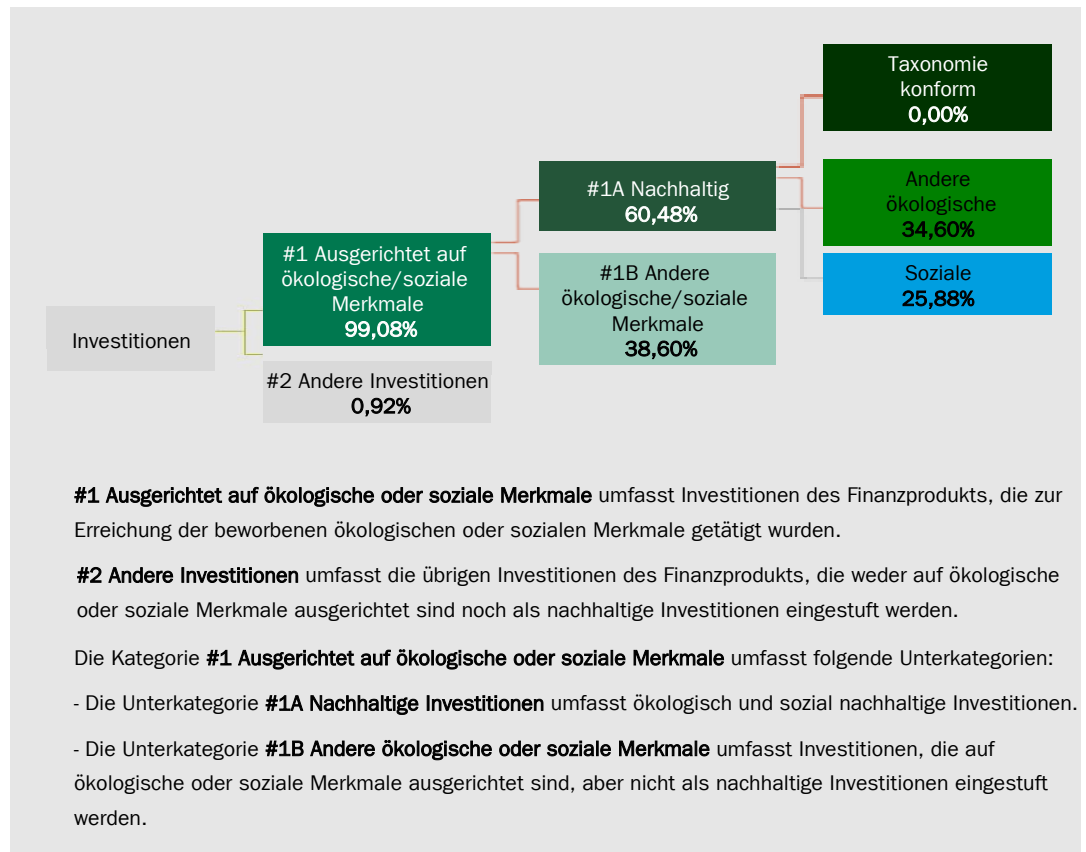
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 60,48%.

34,6% der Investitionen des Finanzprodukts waren ökologisch nachhaltige Investitionen, und 25,88% der Investitionen des Finanzprodukts waren sozial nachhaltige Investitionen. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Bezeichnung des Sektors	Anteil der Investitionen
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Sonstige Kreditinstitute (ohne Spezialkreditinstitute)	14,24%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	5,58%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,92%
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung – Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	3,90%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	3,49%
Information und Kommunikation – Verlagswesen	3,23%
Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen – Einzelhandel (ohne Handel mit Kraftfahrzeugen)	2,76%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von pharmazeutischen Erzeugnissen	2,53%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Beteiligungsgesellschaften	2,06%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Nichtlebensversicherung	2,02%
Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Grundstücks- und Wohnungswesen	1,84%
Energieversorgung – Elektrizitäts-, Gas-, Wärme- und Kälteversorgung	1,72%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Fondsmanagement	1,61%
Information und Kommunikation – Verlegen von sonstiger Software	1,59%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Maschinenbau	1,56%
Gesundheits- und Sozialwesen – Gesundheitswesen	1,55%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Zentralbanken	1,24%
Information und Kommunikation – Programmierstätigkeiten	1,20%
Information und Kommunikation – Informationsdienstleistungen	1,20%
Andere	42,78%

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** enthalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend; dieses Finanzprodukt hat sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel verpflichtet, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert(1)?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

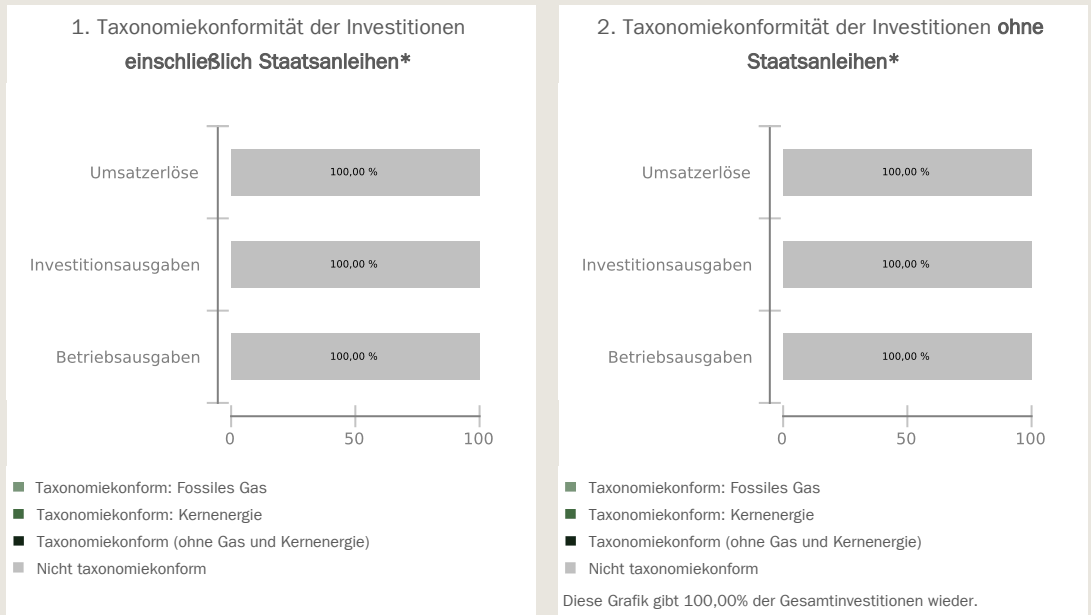
Nein

(1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind: 0,00%

Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind: 0,00%

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen	Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen (J-1)
0,00%	0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden: 34,60%

Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein; allerdings ist der Anlageverwalter gegenwärtig nicht in der Lage, den Anteil der zugrundeliegenden Investitionen des Finanzprodukts, berechnet gemäß der EU-Taxonomie, genau anzugeben. Diese Position wird jedoch weiterhin geprüft, während die zugrundeliegenden Regelungen im Laufe der Zeit fertiggestellt und mehr zuverlässige Daten verfügbar werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen: 25,88%



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts folgte einem rigorosen Verfahren, bei dem durchgängig ESG-Aspekte berücksichtigt wurden. Der Anlageverwalter wendete bei seiner Strategie die folgenden verbindlichen Kriterien an:

- (a) Ausschluss von Anlagen in umstrittenen Geschäftsaktivitäten gemäß den Ausschlussrichtlinien von JSS;
- (b) Erreichung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte nicht in mit C oder D bewertete Emittenten.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Name des Produkts: JSS Investmentfonds SICAV – JSS Sustainable Equity – Green Planet
 Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300CV5RVE3YTN2353

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Nachhaltiges Investitionsziel

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input type="checkbox"/> Nein
<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : 85,63%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es __% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input checked="" type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel	<input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : 12,96%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Ziel des Produkts ist die Förderung der „Grünen Wende“ durch Investitionen in Unternehmen, die zur Entwicklung von Umweltschutzlösungen beitragen. Zu diesem Zweck investierte das Produkt in „Grüne Gewinner“, d. h. Unternehmen, die Lösungen für wesentliche Umweltprobleme anbieten, denen sich unser Planet heute gegenüber sieht, und Unternehmen im Anfangsstadium sowie Unternehmen mit geringer und mittlerer Marktkapitalisierung, die bahnbrechende Umwelttechnologien entwickeln. Das Produkt legte den Schwerpunkt auf Unternehmen mit „grünen“ Erträgen. Das Produkt erzielte einen durchschnittlichen Anteil von 30% an „grünen“ Erträgen für das Gesamtportfolio. Das Finanzprodukt zielte darauf ab, zu einer Reihe ökologischer Ziele beizutragen, darunter Bekämpfung des Klimawandels, Anpassung an den Klimawandel, nachhaltige Nutzung und Schutz von Wasser- und Meeresressourcen, Übergang zur Kreislaufwirtschaft, Vermeidung und Verminderung der Umweltverschmutzung sowie Schutz und Wiederherstellung der Biodiversität und der Ökosysteme. Es wurde kein Referenzindikator zum Zweck der Erreichung des nachhaltigen Anlageziels des Produkts festgelegt.

Wie weit das Produkt das nachhaltige Anlageziel erreicht, wird mittels folgender Nachhaltigkeitsindikatoren bemessen:

- Verhältnis der anhand der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix mit A und der mit B bewerteten Vermögenswerte. Bei den mit A bewerteten Emittenten wird davon ausgegangen, dass sie ein überlegenes ESG-Profil aufweisen, Branchenführer sind und sich für alle nachhaltigen Strategien eignen. Mit B bewertete Emittenten kommen für integrierte nachhaltige Strategien in Betracht;

- Kohlenstoffbilanz (Ansprüche für CO₂-Emissionen pro Millionen investierten US-Dollar);

- „Grüne“ Erträge, gemessen anhand des verhältnismäßigen Anteils der Erträge des Emittenten aus Produkten, die eine erhebliche Verringerung der Emissionen mittels innovativer Lösungen ermöglichen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	86
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	14
ESG-Rating von JSS: Durchschnittliches Unternehmensrating	Von 0 (gering) bis 5 (hoch)	3,45
CO2-Fußabdruck	Tonnen CO2 pro investierter Million US-Dollar	53,45
Durchschnittlicher Anteil von „grünen“ Erträgen am Gesamtertrag	Prozentualer Anteil	53

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators (J-1)
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	86	91
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	14	9
ESG-Rating von JSS: Durchschnittliches Unternehmensrating	Von 0 (gering) bis 5 (hoch)	3,45	3,42
CO2-Fußabdruck	Tonnen CO2 pro investierter Million US-Dollar	53,45	61,65
Durchschnittlicher Anteil von „grünen“ Erträgen am Gesamtertrag	Prozentualer Anteil	53	47

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern wurden nachhaltige Investitionsziele durch die nachhaltigen Investitionen nicht erheblich beeinträchtigt?

Die Prüfung auf erhebliche Beeinträchtigungen (Do no significant harm, „DSNH“) schließt Emittenten aus, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellenwerte der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen nicht erreichen. Ein Emittent besteht die Prüfung, wenn er nach der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Bewertung A oder B erhält. Wenn der Emittent im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist, muss er außerdem über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügen, um die Prüfung zu bestehen. Zu den Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen gehören Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie Kraftwerks- und Koks Kohle.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf

Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen nach Maßgabe der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen im Rahmen des Investitionsprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten negativen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Investitionen erreicht, die die ökologischen oder sozialen Mindestschwellenwerte nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Mitwirkungsmaßnahmen dienen der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Die Definition des ESG-Auswahlverfahrens und Anlageuniversums beruht auf den Richtlinien und der Strategie von JSS für nachhaltiges Investieren, in denen die Prinzipien mehrerer internationaler Übereinkommen und Normen enthalten sind, u. a.:

Die Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen,

Die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

Der Global Compact der Vereinten Nationen,

Die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

Die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

Die Grundsätze zu Kinderrechten und unternehmerischem Handeln,

Die Arbeitsstandards der ILO,

Die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

Das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

Das Übereinkommen über Streumunition.

Der ESG-Auswahlprozess trägt dazu bei, börsennotierte Unternehmen zu ermitteln, die vermeintlich gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung verstoßen, wie in den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte vorgesehen. Diese Unternehmen werden als unvereinbar mit den o. a. Prinzipien erachtet und aus dem Universum nachhaltiger Investitionen von JSS ausgeschlossen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Unternehmen

THG-Emissionen, CO₂-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind, Anteil des Verbrauchs und der Erzeugung von nicht erneuerbaren Energien, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (berücksichtigt für Ausschlüsse, Klimaversprechen und innerhalb der Nachhaltigkeitsmatrix)

Die schädlichsten Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe werden ausgeschlossen. Seit

dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Umsätze aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 10\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 10\%$ aus einer Kombination aus dem Kraftwerkskohlebergbau und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

In Sektoren, in denen CO₂-Emissionen einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine CO₂-Emissionen. Dies umfasst eine Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Senkung der Emissionsintensität seines Kerngeschäfts, zur Senkung seines künftigen Energieverbrauchs oder seiner Treibhausgasemissionen (Scope 1, 2 und 3).

In Sektoren, in denen Möglichkeiten im Bereich der erneuerbaren Energien einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf erneuerbare Energien. Hierzu zählt auch die Bewertung der Kapazität eines Unternehmens im Bereich der erneuerbaren Energien.

Im Mai 2020 hat JSS ein Klimaversprechen abgegeben, das auf Klimaneutralität bis zum Jahr 2035 abzielt. Bei Fonds, bei denen dieses Versprechen bereits umgesetzt wurde, werden Treibhausgasemissionen anhand des CO₂-Fußabdrucks überwacht; diese Kontrollen werden für eine Teilmenge der Fonds durchgeführt. Die Einhaltung des Klimaversprechens wird mithilfe rückwärtsgerichteter Dekarbonisierungspfade überprüft, mit denen Übergangsrisiken gemindert werden sollen. Die meisten Fonds, die das Klimaversprechen umgesetzt haben, wenden folgende Methode an: Das ursprüngliche Ziel entspricht einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen des Referenzwerts um 30%. Diese Zielvorgabe wird in den folgenden Jahren um 7% verringert. Ab 2030 wird das Ziel linear gesenkt, bis das Netto-Null-Ziel im Jahr 2035 schließlich erreicht wird. Die THG-Emissionen des Portfolios auf der Grundlage der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro Mio. USD des Unternehmenswertes (EVIC) ausgedrückt.

Tätigkeiten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung wesentliche ESG-Faktoren darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf Biodiversität und Landnutzung. Hierzu zählt auch eine Bewertung der Auswirkungen der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens auf die Biodiversität. Zudem wird Palmöl konsequent ausgeschlossen.

Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Emissionen in Wasser (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Emissionen in Wasser erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Wasserbewirtschaftung. Die Wasserbewirtschaftung umfasst eine Bewertung wassereffizienter Produktionsprozesse, Trends bei der Wasserintensität sowie messbare, zeitlich befristete Zielvorgaben zur Senkung des Wasserverbrauchs. Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Gefährlicher Abfall (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Schadstoffemissionen und schädlichen Abfällen erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Schadstoffemissionen und seine Abfallwirtschaft. Der Umgang mit Schadstoffemissionen umfasst eine Bewertung der Bemühungen zur Kontrolle und Verringerung der Menge giftiger und krebserregender Nebenprodukte im Rahmen der Geschäftstätigkeit, Trends bei der Schadstofffreisetzung sowie messbare, zeitlich begrenzte Zielvorgaben zur Reduzierung von Schadstoffemissionen.

Verstöße gegen UNGC-Grundsätze (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Fehlende Prozesse zur Überwachung der Einhaltung des UNGC

Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Bestandteil der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Investitionsprozess einbeziehen, sobald die Offenlegungsquoten ausreichend sind. In der Zwischenzeit erfolgt eine ESG-Überwachung, bei der unter anderem regelmäßige Screenings auf Verstöße gegen die UNGC-Vorgaben durchgeführt werden. JSS strebt eine Berücksichtigung dieses Indikators an, sobald sich die Datenzuverlässigkeit und -verfügbarkeit verbessern.

Engagement in umstrittenen Waffen (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS wird seiner Verantwortung in Bezug auf umstrittene Waffen aktiv gerecht, indem es sie konzernweit ausschließt. JSS investiert keine Eigenmittel in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich der umstrittenen Waffen tätig sind. Ferner übernimmt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für solche Unternehmen bzw. keine Dienstleistungen im Zusammenhang mit Kapitalmärkten oder Fusionen und Übernahmen.

Staaten

THG-Emissionsintensität (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die externen Umweltkosten eines Landes. Bewertet werden unter anderem die Treibhausgasemissionen pro Kopf.

Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Landes in Bezug auf Grundrechte.



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:
01.07.2023 – 30.06.2024

Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
REPUBLIC SERVICES INC	Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	5,38	US
MICROSOFT CORP	Information und Kommunikation	5,13	US
CLEAN HARBORS INC	Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	3,72	US
PTC INC	Information und Kommunikation	3,61	US
SIEMENS AG-REG	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,59	DE
ROPER TECHNOLOGIES INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,36	US
XYLEM INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,27	US
VEOLIA ENVIRONNEMENT	Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen	3,14	FR
STANTEC INC	Baugewerbe/Bau	3,04	CA
ARCADIS NV	Baugewerbe/Bau	2,91	NL
ECOLAB INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,87	US
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,70	US
NATIONAL GRID PLC	Energieversorgung	2,67	GB
METSO CORP	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,64	FI
ADVANCED DRAINAGE SYSTEMS IN	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,57	US

Hauptinvestitionen per 30.06.2024 (Ende des Geschäftsjahres). Keine bedeutenden Abweichungen über das Geschäftsjahr.

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.



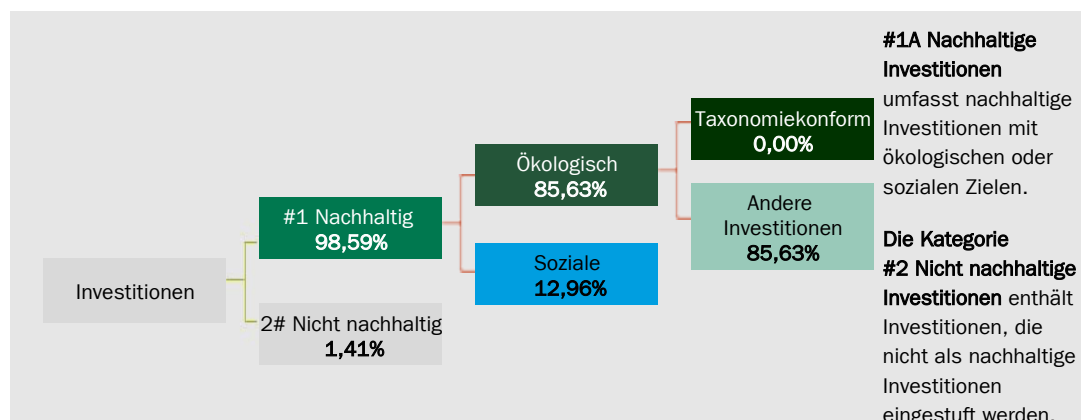
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 98,59%.

85,63% der Investitionen des Finanzprodukts waren ökologisch nachhaltige Investitionen, und 12,96% der Investitionen des Finanzprodukts waren sozial nachhaltige Investitionen. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Nicht nachhaltige Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Bezeichnung des Sektors	Anteil der Investitionen
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Maschinenbau	18,49%
Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen – Sammlung, Behandlung und Beseitigung von Abfällen; Rückgewinnung	10,44%
Information und Kommunikation – Verlegen von sonstiger Software	6,66%
Energieversorgung – Elektrizitäts-, Gas-, Wärme- und Kälteversorgung	6,38%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	6,18%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von elektronischen Bauelementen	6,03%
Baugewerbe/Bau – Tiefbau	5,95%
Information und Kommunikation – Verlagswesen	5,46%
Wasserversorgung; Abwasser- und Abfallentsorgung und Beseitigung von Umweltverschmutzungen – Wasserversorgung	4,77%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Verbrennungsmotoren und Turbinen (ohne Motoren für Luft- und Straßenfahrzeuge)	4,54%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Seifen, Wasch- und Reinigungsmitteln	2,87%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Bestrahlungs- und Elektrotherapiegeräten und elektromedizinischen Geräten	2,70%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Gummi- und Kunststoffwaren	2,57%
Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen – Architektur- und Ingenieurbüros	2,43%
Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen – Architektur- und Ingenieurbüros; technische, physikalische und chemische Untersuchung	2,21%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Getränkeherstellung	2,13%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Metallerzeugnissen	1,80%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Klebstoffen	1,54%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Fondsmanagement	1,27%
Andere	5,55%

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf vollständig erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** enthalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend; dieses Finanzprodukt hat sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel verpflichtet, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonmiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert(1)?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

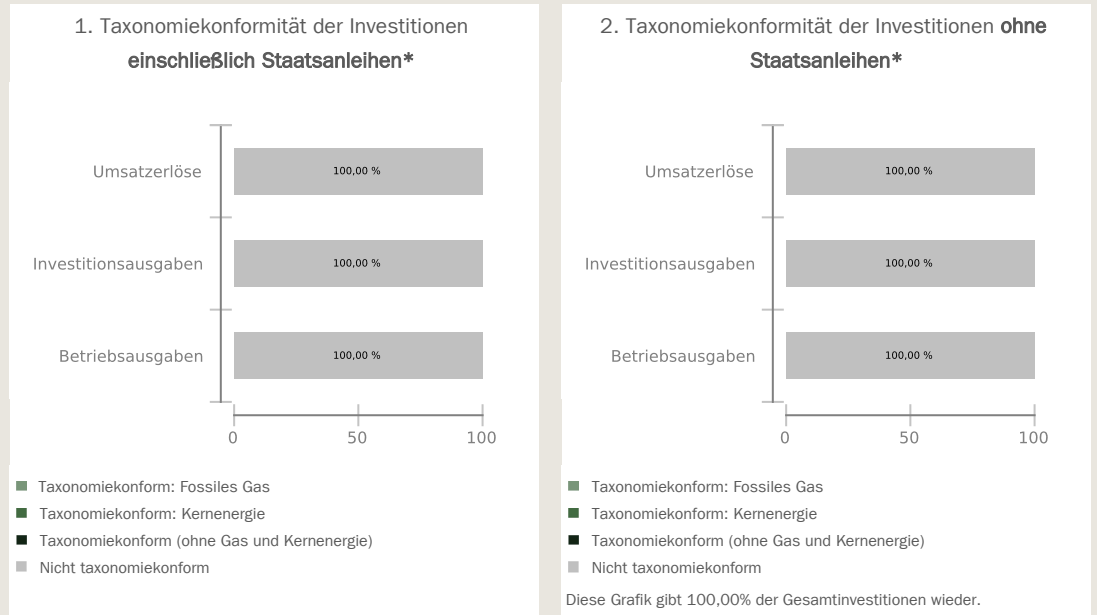
Nein

(1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonmiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonmiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind: 0,00%

Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind: 0,00%

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen	Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen (J-1)
0,00%	0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.



● **Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?**

Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden: 85,63%

Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein; allerdings ist der Anlageverwalter gegenwärtig nicht in der Lage, den Anteil der zugrundeliegenden Investitionen des Finanzprodukts, berechnet gemäß der EU-Taxonomie, genau anzugeben. Diese Position wird jedoch weiterhin geprüft, während die zugrundeliegenden Regelungen im Laufe der Zeit fertiggestellt und mehr zuverlässige Daten verfügbar werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil nachhaltiger Investitionen mit einem sozialen Ziel: 12,96%

Seit dem 20. Juni 2024 verpflichtet sich dieses Finanzprodukt nicht mehr zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem sozialen Ziel.

Das Dokument mit den vorvertraglichen Informationen wurde entsprechend aktualisiert.



Welche Investitionen fielen unter „nicht nachhaltige Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Nicht nachhaltige Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erreichung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts folgte einem rigorosen Verfahren, bei dem durchgängig ESG-Aspekte berücksichtigt wurden. Der Anlageverwalter wendete bei seiner Strategie die folgenden verbindlichen Kriterien an:

(a) Ausschluss von Anlagen in umstrittenen Geschäftsaktivitäten gemäß den Ausschlussrichtlinien von JSS;

(b) Erreichung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte nicht in mit C oder D bewertete Emittenten.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Nachhaltigkeitsreferenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie unterschied sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf das nachhaltige Investitionsziel bestimmt wird?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt das nachhaltige Investitionsziel erreicht.

Name des Produkts: JSS Investmentfonds SICAV – JSS Sustainable Bond – Total Return Global
 Unternehmenskennung (LEI-Code): 222100J1DCHVW8IPFU12

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 79,69% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt integriert umweltbezogene, soziale und die Unternehmensführung betreffende Aspekte („ESG“) in den Investitionsprozess mit dem Ziel, ein überdurchschnittlich gutes ESG-Profil für das gesamte Portfolio gemäß der von J. Safra Sarasin („JSS“) entwickelten Nachhaltigkeitsmatrix zu erreichen.

Das ESG-Rating von JSS bewertet die Emittenten im Verhältnis zu ihrer Vergleichsgruppe und reicht von A für Emittenten, die in die Spitzenklasse eingestuft werden, bis zu D für Emittenten, die ggf. eine umstrittene Geschäftstätigkeit ausüben. Beim nachhaltigen Investieren werden Emittenten, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und bei denen die Wahrscheinlichkeit für erhebliche Beeinträchtigungen daher erhöht ist, mit C (schlechteste Leistung im Branchenvergleich) oder D (wegen umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse von Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, die Kreditratings von Staaten unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien zu analysieren. JSS misst die nachhaltige Wirtschaftsleistung eines Landes nach (i) der Verfügbarkeit von natürlichen Ressourcen und (ii) danach, wie effizient diese eingesetzt werden. Die Nachhaltigkeitsbewertungen von Ländern stellen ein ergänzendes Instrument der finanziellen Analyse ihrer Kreditratings dar.

Folgende Ausschlusskriterien (mit Umsatzschwellen) wurden im Berichtszeitraum auf das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Waffenarten, die angesichts ihrer langfristigen humanitären Folgen und/oder der großen Anzahl ziviler Opfer bei ihrem Einsatz als umstritten

eingestuft werden. Dazu zählen u. a. biologische, chemische und atomare Waffen, Streumunition und Anti-Personenminen (Umsatzschwelle: 0%);

- Verteidigung und Rüstung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und wesentliche Bauteile) sowie Hilfssysteme und Dienstleistungen im Zusammenhang mit Waffen (Waffeneinsatzsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5%);

- Kohle: Unternehmen, die in erheblichem Umfang im Kohlegeschäft tätig sind und zugleich keine solide Strategie für den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft vorweisen können (Umsatzschwelle: 5% für den Kohlebergbau, 10% für die Kohleverstromung sowie 10% für die Summe aus beiden Komponenten);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen zwecks landwirtschaftlicher Nutzung gentechnisch verändern (Umsatzschwelle: 0%);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0%);

- Tabak: Hersteller von Tabakprodukten (Umsatzschwelle: 5%);

- Erwachsenenunterhaltung: Produzenten von Erwachsenenunterhaltung (Umsatzschwelle: 5%);

- Verstöße gegen Menschenrechte und sonstige Prinzipien des Global Compact: Unternehmen, die nach Maßgabe anerkannter internationaler Standards an schweren Verstößen gegen Menschenrechte oder sonstige Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen beteiligt sind (Umsatzschwelle: 0%).

- Palmöl: Unternehmen mit einem Bezug zu Palmöl ohne ausreichende Zertifizierung durch den Roundtable on Sustainable Palm Oil („RSPO“) werden ausgeschlossen (Umsatzschwelle: 5% für Palmölproduzenten, wenn weniger als 75% der Standorte eine RSPO-Zertifizierung besitzen).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Zeitpunkt dar. Bei nachhaltigen Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem sozialen Ziel beitragen, wird davon ausgegangen, dass sie zu beiden gleichermaßen beitragen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● *Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?*

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	86
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	13

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators (J-1)
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	86	45
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	13	49

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der CO₂-Emissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren Zielen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) in Einklang stehen, oder durch die Einnahme einer Spitzenposition im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren innerhalb der Vergleichsgruppe.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Prüfung auf erhebliche Beeinträchtigungen (Do no significant harm, „DSNH“) schließt Emittenten aus, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellenwerte der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen nicht erreichen. Ein Emittent besteht die Prüfung, wenn er nach der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Bewertung A oder B erhält. Wenn der Emittent im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist, muss er außerdem über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügen, um die Prüfung zu bestehen. Zu den Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen gehören Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie Kraftwerks- und Koks Kohle.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen nach Maßgabe der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen im Rahmen des Investitionsprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten negativen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Investitionen erreicht, die die ökologischen oder sozialen Mindestschwellenwerte nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Mitwirkungsmaßnahmen dienen der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Die Definition des ESG-Auswahlverfahrens und Anlageuniversums beruht auf den

Richtlinien und der Strategie von JSS für nachhaltiges Investieren, in denen die Prinzipien mehrerer internationaler Übereinkommen und Normen enthalten sind, u. a.:

Die Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen,

Die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

Der Global Compact der Vereinten Nationen,

Die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

Die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

Die Grundsätze zu Kinderrechten und unternehmerischem Handeln,

Die Arbeitsstandards der ILO,

Die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

Das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

Das Übereinkommen über Streumunition.

Der ESG-Auswahlprozess trägt dazu bei, börsennotierte Unternehmen zu ermitteln, die vermeintlich gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung verstoßen, wie in den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte vorgesehen. Diese Unternehmen werden als unvereinbar mit den o. a. Prinzipien erachtet und aus dem Universum nachhaltiger Investitionen von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Unternehmen

THG-Emissionen, CO₂-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind, Anteil des Verbrauchs und der Erzeugung von nicht erneuerbaren Energien, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (berücksichtigt für Ausschlüsse, Klimaversprechen und innerhalb der Nachhaltigkeitsmatrix)

Die schädlichsten Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe werden ausgeschlossen. Seit dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Umsätze aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 10\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 10\%$ aus einer Kombination aus dem Kraftwerkskohlebergbau und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

In Sektoren, in denen CO₂-Emissionen einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine CO₂-Emissionen. Dies umfasst eine Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Senkung der Emissionsintensität seines Kerngeschäfts, zur Senkung seines künftigen Energieverbrauchs oder seiner Treibhausgasemissionen (Scope 1, 2 und 3).

In Sektoren, in denen Möglichkeiten im Bereich der erneuerbaren Energien einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf erneuerbare Energien. Hierzu zählt auch die Bewertung der Kapazität eines Unternehmens im Bereich der erneuerbaren Energien.

Im Mai 2020 hat JSS ein Klimaversprechen abgegeben, das auf Klimaneutralität bis zum Jahr 2035 abzielt. Bei Fonds, bei denen dieses Versprechen bereits umgesetzt wurde, werden Treibhausgasemissionen anhand des CO₂-Fußabdrucks überwacht; diese Kontrollen werden für eine Teilmenge der Fonds durchgeführt. Die Einhaltung des Klimaversprechens wird mithilfe rückwärtsgerichteter Dekarbonisierungspfade überprüft, mit denen Übergangsrisiken gemindert werden sollen. Die meisten Fonds, die das Klimaversprechen umgesetzt haben, wenden folgende Methode an: Das ursprüngliche Ziel entspricht einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen des Referenzwerts um 30%. Diese Zielvorgabe wird in den folgenden Jahren um 7% verringert. Ab 2030 wird das Ziel linear gesenkt, bis das Netto-Null-Ziel im Jahr 2035 schließlich erreicht wird. Die THG-Emissionen des Portfolios auf der Grundlage der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro Mio. USD des Unternehmenswertes (EVIC) ausgedrückt.

Tätigkeiten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung wesentliche ESG-Faktoren darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf Biodiversität und Landnutzung. Hierzu zählt auch eine Bewertung der Auswirkungen der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens auf die Biodiversität. Zudem wird Palmöl konsequent ausgeschlossen.

Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Emissionen in Wasser (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Emissionen in Wasser erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Wasserbewirtschaftung. Die Wasserbewirtschaftung umfasst eine Bewertung wassereffizienter Produktionsprozesse, Trends bei der Wasserintensität sowie messbare, zeitlich befristete Zielvorgaben zur Senkung des Wasserverbrauchs. Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Gefährlicher Abfall (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Schadstoffemissionen und schädlichen Abfällen erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Schadstoffemissionen und seine Abfallwirtschaft. Der Umgang mit Schadstoffemissionen umfasst eine Bewertung der Bemühungen zur Kontrolle und Verringerung der Menge giftiger und krebserregender Nebenprodukte im Rahmen der Geschäftstätigkeit, Trends bei der Schadstofffreisetzung sowie messbare, zeitlich begrenzte Zielvorgaben zur Reduzierung von Schadstoffemissionen.

Verstöße gegen UNGC-Grundsätze (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Fehlende Prozesse zur Überwachung der Einhaltung des UNGC

Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Bestandteil der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Investitionsprozess einbeziehen, sobald die Offenlegungsquoten ausreichend

sind. In der Zwischenzeit erfolgt eine ESG-Überwachung, bei der unter anderem regelmäßige Screenings auf Verstöße gegen die UNGC-Vorgaben durchgeführt werden. JSS strebt eine Berücksichtigung dieses Indikators an, sobald sich die Datenzuverlässigkeit und -verfügbarkeit verbessern.

Engagement in umstrittenen Waffen (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS wird seiner Verantwortung in Bezug auf umstrittene Waffen aktiv gerecht, indem es sie konzernweit ausschließt. JSS investiert keine Eigenmittel in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich der umstrittenen Waffen tätig sind. Ferner übernimmt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für solche Unternehmen bzw. keine Dienstleistungen im Zusammenhang mit Kapitalmärkten oder Fusionen und Übernahmen.

Staaten

THG-Emissionsintensität (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die externen Umweltkosten eines Landes. Bewertet werden unter anderem die Treibhausgasemissionen pro Kopf.

Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Landes in Bezug auf Grundrechte.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel:
01.07.2023 – 30.06.2024

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
US TREASURY N/B	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	7,57	US
REGIERUNG AUSTRALIENS	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	6,34	AU
US TREASURY N/B	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	5,84	US
US TREASURY N/B	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	5,65	US
US TREASURY N/B	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	4,68	US
REGIERUNG AUSTRALIENS	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	4,67	AU
BRITISCHE STAATSANLEIHEN	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	3,31	GB
REGIERUNG AUSTRALIENS	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	3,10	AU
US TREASURY N/B	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	2,97	US
REGIERUNG AUSTRALIENS	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	2,78	AU
REGIERUNG NORWEGENS	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	2,61	NO
US TREASURY N/B	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	2,42	US

Hauptinvestitionen per 30.06.2024 (Ende des Geschäftsjahres). Keine bedeutenden Abweichungen über das Geschäftsjahr.

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Die Gewichtung von Anleihen wird ermittelt, indem der Marktpreis der Anleihe (einschließlich aufgelaufener Zinsen) durch das Gesamtnettovermögen des Teilfonds geteilt wird.



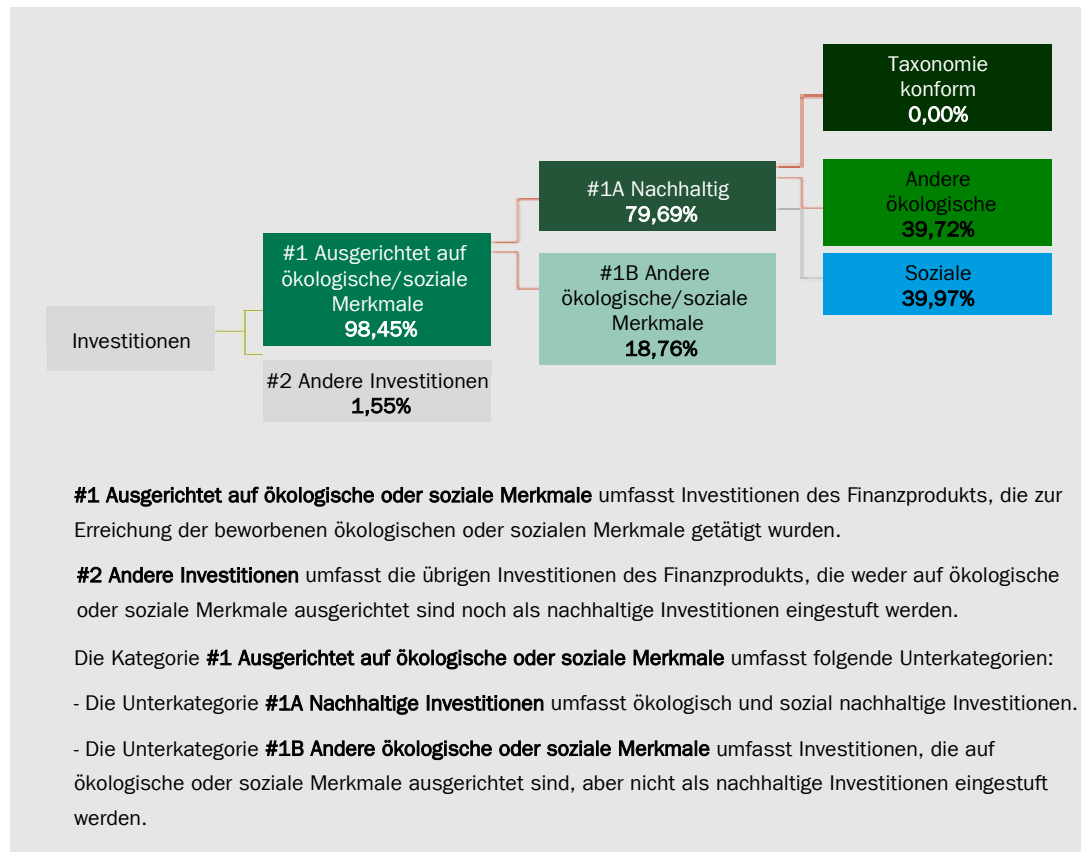
Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 79,69%.

39,72% der Investitionen des Finanzprodukts waren ökologisch nachhaltige Investitionen, und 39,97% der Investitionen des Finanzprodukts waren sozial nachhaltige Investitionen. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Bezeichnung des Sektors	Anteil der Investitionen
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung – Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	34,34%
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung – Allgemeine öffentliche Verwaltung	33,03%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Spezialkreditinstitute	3,82%
Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden – Erbringung von Dienstleistungen für den Bergbau und für die Gewinnung von Steinen und Erden	3,54%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Beteiligungsgesellschaften	2,77%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Treuhand- und sonstige Fonds und ähnliche Finanzinstitutionen	2,55%
Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften - Extraterritoriale Organisationen und Körperschaften	2,08%
Information und Kommunikation – Telekommunikation	1,42%
Energieversorgung – Elektrizitäts-, Gas-, Wärme- und Kälteversorgung	1,17%
Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden – Gewinnung von Erdöl und Erdgas	1,05%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Nichtlebensversicherung	1,03%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Lebensversicherungen	1,01%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Kokerei und Mineralölverarbeitung	1,00%
Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen – Einzelhandel mit Waren verschiedener Art, Hauptrichtung Nahrungs- und Genussmittel, Getränke und Tabakwaren	0,83%
Information und Kommunikation – Drahtlose Telekommunikation	0,79%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von chemischen Erzeugnissen	0,74%
Erbringung von sonstigen Dienstleistungen – Erbringung von sonstigen überwiegend persönlichen Dienstleistungen	0,73%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Papier, Pappe und Waren daraus	0,73%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Kunststoffen in Primärformen	0,71%
Andere	6,66%

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** enthalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend; dieses Finanzprodukt hat sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel verpflichtet, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert(1)?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

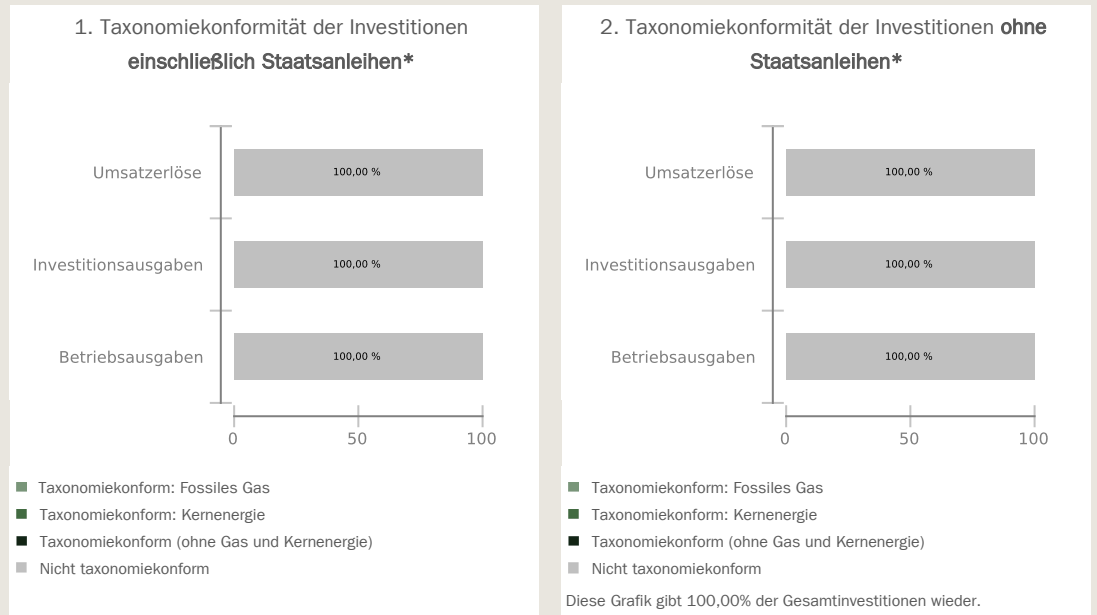
Nein

(1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind: 0,00%

Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind: 0,00%

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen	Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen (J-1)
0,00%	0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden: 39,72%

Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein; allerdings ist der Anlageverwalter gegenwärtig nicht in der Lage, den Anteil der zugrundeliegenden Investitionen des Finanzprodukts, berechnet gemäß der EU-Taxonomie, genau anzugeben. Diese Position wird jedoch weiterhin geprüft, während die zugrundeliegenden Regelungen im Laufe der Zeit fertiggestellt und mehr zuverlässige Daten verfügbar werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen: 39,97%



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts folgte einem rigorosen Verfahren, bei dem durchgängig ESG-Aspekte berücksichtigt wurden. Der Anlageverwalter wendete bei seiner Strategie die folgenden verbindlichen Kriterien an:

(a) Ausschluss von Anlagen in umstrittenen Geschäftsaktivitäten gemäß den Ausschlussrichtlinien von JSS;

(b) Erreichung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte nicht in mit C oder D bewertete Emittenten.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Name des Produkts: JSS Investmentfonds SICAV – JSS Sustainable Equity – Next-Gen Consumer
 Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300YICDN2YHCAFG20

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja		Nein	
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 80,15% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/>		<input type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt integriert umweltbezogene, soziale und die Unternehmensführung betreffende Aspekte („ESG“) in den Investitionsprozess mit dem Ziel, ein überdurchschnittlich gutes ESG-Profil für das gesamte Portfolio gemäß der von J. Safra Sarasin („JSS“) entwickelten Nachhaltigkeitsmatrix zu erreichen.

Das ESG-Rating von JSS bewertet die Emittenten im Verhältnis zu ihrer Vergleichsgruppe und reicht von A für Emittenten, die in die Spitzenklasse eingestuft werden, bis zu D für Emittenten, die ggf. eine umstrittene Geschäftstätigkeit ausüben. Beim nachhaltigen Investieren werden Emittenten, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und bei denen die Wahrscheinlichkeit für erhebliche Beeinträchtigungen daher erhöht ist, mit C (schlechteste Leistung im Branchenvergleich) oder D (wegen umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse von Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, die Kreditratings von Staaten unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien zu analysieren. JSS misst die nachhaltige Wirtschaftsleistung eines Landes nach (i) der Verfügbarkeit von natürlichen Ressourcen und (ii) danach, wie effizient diese eingesetzt werden. Die Nachhaltigkeitsbewertungen von Ländern stellen ein ergänzendes Instrument der finanziellen Analyse ihrer Kreditratings dar.

Folgende Ausschlusskriterien (mit Umsatzschwellen) wurden im Berichtszeitraum auf das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Waffenarten, die angesichts ihrer langfristigen humanitären Folgen und/oder der großen Anzahl ziviler Opfer bei ihrem Einsatz als umstritten

eingestuft werden. Dazu zählen u. a. biologische, chemische und atomare Waffen, Streumunition und Anti-Personenminen (Umsatzschwelle: 0%);

- Verteidigung und Rüstung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und wesentliche Bauteile) sowie Hilfssysteme und Dienstleistungen im Zusammenhang mit Waffen (Waffeneinsatzsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5%);

- Kohle: Unternehmen, die in erheblichem Umfang im Kohlegeschäft tätig sind und zugleich keine solide Strategie für den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft vorweisen können (Umsatzschwelle: 5% für den Kohlebergbau, 10% für die Kohleverstromung sowie 10% für die Summe aus beiden Komponenten);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen zwecks landwirtschaftlicher Nutzung gentechnisch verändern (Umsatzschwelle: 0%);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0%);

- Tabak: Hersteller von Tabakprodukten (Umsatzschwelle: 5%);

- Erwachsenenunterhaltung: Produzenten von Erwachsenenunterhaltung (Umsatzschwelle: 5%);

- Verstöße gegen Menschenrechte und sonstige Prinzipien des Global Compact: Unternehmen, die nach Maßgabe anerkannter internationaler Standards an schweren Verstößen gegen Menschenrechte oder sonstige Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen beteiligt sind (Umsatzschwelle: 0%).

- Palmöl: Unternehmen mit einem Bezug zu Palmöl ohne ausreichende Zertifizierung durch den Roundtable on Sustainable Palm Oil („RSPO“) werden ausgeschlossen (Umsatzschwelle: 5% für Palmölproduzenten, wenn weniger als 75% der Standorte eine RSPO-Zertifizierung besitzen).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Zeitpunkt dar. Bei nachhaltigen Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem sozialen Ziel beitragen, wird davon ausgegangen, dass sie zu beiden gleichermaßen beitragen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● *Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?*

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	87
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	13

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators (J-1)
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	87	83
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	13	17

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der CO₂-Emissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren Zielen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) in Einklang stehen, oder durch die Einnahme einer Spitzenposition im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren innerhalb der Vergleichsgruppe.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Prüfung auf erhebliche Beeinträchtigungen (Do no significant harm, „DSNH“) schließt Emittenten aus, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellenwerte der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen nicht erreichen. Ein Emittent besteht die Prüfung, wenn er nach der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Bewertung A oder B erhält. Wenn der Emittent im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist, muss er außerdem über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügen, um die Prüfung zu bestehen. Zu den Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen gehören Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie Kraftwerks- und Koks Kohle.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen nach Maßgabe der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen im Rahmen des Investitionsprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten negativen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Investitionen erreicht, die die ökologischen oder sozialen Mindestschwellenwerte nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Mitwirkungsmaßnahmen dienen der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Die Definition des ESG-Auswahlverfahrens und Anlageuniversums beruht auf den

Richtlinien und der Strategie von JSS für nachhaltiges Investieren, in denen die Prinzipien mehrerer internationaler Übereinkommen und Normen enthalten sind, u. a.:

Die Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen,

Die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

Der Global Compact der Vereinten Nationen,

Die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

Die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

Die Grundsätze zu Kinderrechten und unternehmerischem Handeln,

Die Arbeitsstandards der ILO,

Die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

Das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

Das Übereinkommen über Streumunition.

Der ESG-Auswahlprozess trägt dazu bei, börsennotierte Unternehmen zu ermitteln, die vermeintlich gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung verstoßen, wie in den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte vorgesehen. Diese Unternehmen werden als unvereinbar mit den o. a. Prinzipien erachtet und aus dem Universum nachhaltiger Investitionen von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Unternehmen

THG-Emissionen, CO₂-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind, Anteil des Verbrauchs und der Erzeugung von nicht erneuerbaren Energien, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (berücksichtigt für Ausschlüsse, Klimaversprechen und innerhalb der Nachhaltigkeitsmatrix)

Die schädlichsten Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe werden ausgeschlossen. Seit dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Umsätze aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 10\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 10\%$ aus einer Kombination aus dem Kraftwerkskohlebergbau und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

In Sektoren, in denen CO₂-Emissionen einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine CO₂-Emissionen. Dies umfasst eine Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Senkung der Emissionsintensität seines Kerngeschäfts, zur Senkung seines künftigen Energieverbrauchs oder seiner Treibhausgasemissionen (Scope 1, 2 und 3).

In Sektoren, in denen Möglichkeiten im Bereich der erneuerbaren Energien einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf erneuerbare Energien. Hierzu zählt auch die Bewertung der Kapazität eines Unternehmens im Bereich der erneuerbaren Energien.

Im Mai 2020 hat JSS ein Klimaversprechen abgegeben, das auf Klimaneutralität bis zum Jahr 2035 abzielt. Bei Fonds, bei denen dieses Versprechen bereits umgesetzt wurde, werden Treibhausgasemissionen anhand des CO₂-Fußabdrucks überwacht; diese Kontrollen werden für eine Teilmenge der Fonds durchgeführt. Die Einhaltung des Klimaversprechens wird mithilfe rückwärtsgerichteter Dekarbonisierungspfade überprüft, mit denen Übergangsrisiken gemindert werden sollen. Die meisten Fonds, die das Klimaversprechen umgesetzt haben, wenden folgende Methode an: Das ursprüngliche Ziel entspricht einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen des Referenzwerts um 30%. Diese Zielvorgabe wird in den folgenden Jahren um 7% verringert. Ab 2030 wird das Ziel linear gesenkt, bis das Netto-Null-Ziel im Jahr 2035 schließlich erreicht wird. Die THG-Emissionen des Portfolios auf der Grundlage der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro Mio. USD des Unternehmenswertes (EVIC) ausgedrückt.

Tätigkeiten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung wesentliche ESG-Faktoren darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf Biodiversität und Landnutzung. Hierzu zählt auch eine Bewertung der Auswirkungen der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens auf die Biodiversität. Zudem wird Palmöl konsequent ausgeschlossen.

Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Emissionen in Wasser (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Emissionen in Wasser erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Wasserbewirtschaftung. Die Wasserbewirtschaftung umfasst eine Bewertung wassereffizienter Produktionsprozesse, Trends bei der Wasserintensität sowie messbare, zeitlich befristete Zielvorgaben zur Senkung des Wasserverbrauchs. Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Gefährlicher Abfall (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Schadstoffemissionen und schädlichen Abfällen erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Schadstoffemissionen und seine Abfallwirtschaft. Der Umgang mit Schadstoffemissionen umfasst eine Bewertung der Bemühungen zur Kontrolle und Verringerung der Menge giftiger und krebserregender Nebenprodukte im Rahmen der Geschäftstätigkeit, Trends bei der Schadstofffreisetzung sowie messbare, zeitlich begrenzte Zielvorgaben zur Reduzierung von Schadstoffemissionen.

Verstöße gegen UNGC-Grundsätze (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Fehlende Prozesse zur Überwachung der Einhaltung des UNGC

Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Bestandteil der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Investitionsprozess einbeziehen, sobald die Offenlegungsquoten ausreichend

sind. In der Zwischenzeit erfolgt eine ESG-Überwachung, bei der unter anderem regelmäßige Screenings auf Verstöße gegen die UNGC-Vorgaben durchgeführt werden. JSS strebt eine Berücksichtigung dieses Indikators an, sobald sich die Datenzuverlässigkeit und -verfügbarkeit verbessern.

Engagement in umstrittenen Waffen (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS wird seiner Verantwortung in Bezug auf umstrittene Waffen aktiv gerecht, indem es sie konzernweit ausschließt. JSS investiert keine Eigenmittel in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich der umstrittenen Waffen tätig sind. Ferner übernimmt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für solche Unternehmen bzw. keine Dienstleistungen im Zusammenhang mit Kapitalmärkten oder Fusionen und Übernahmen.

Staaten

THG-Emissionsintensität (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die externen Umweltkosten eines Landes. Bewertet werden unter anderem die Treibhausgasemissionen pro Kopf.

Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Landes in Bezug auf Grundrechte.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 – 30.06.2024

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
AMAZON.COM INC	Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	9,95	US
MICROSOFT CORP	Information und Kommunikation	5,54	US
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	5,13	US
NVIDIA CORP	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,08	US
HERMES INTERNATIONAL	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,78	FR
L'OREAL	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,62	FR
FERRARI NV	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,49	IT
MASTERCARD INC – A	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	3,41	US
MERCADOLIBRE INC	Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	3,39	UY
ALPHABET INC-CL A	Information und Kommunikation	3,34	US
META PLATFORMS INC-CLASS A	Information und Kommunikation	3,20	US
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	2,62	CH

Hauptinvestitionen per 30.06.2024 (Ende des Geschäftsjahres). Keine bedeutenden Abweichungen über das Geschäftsjahr.

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

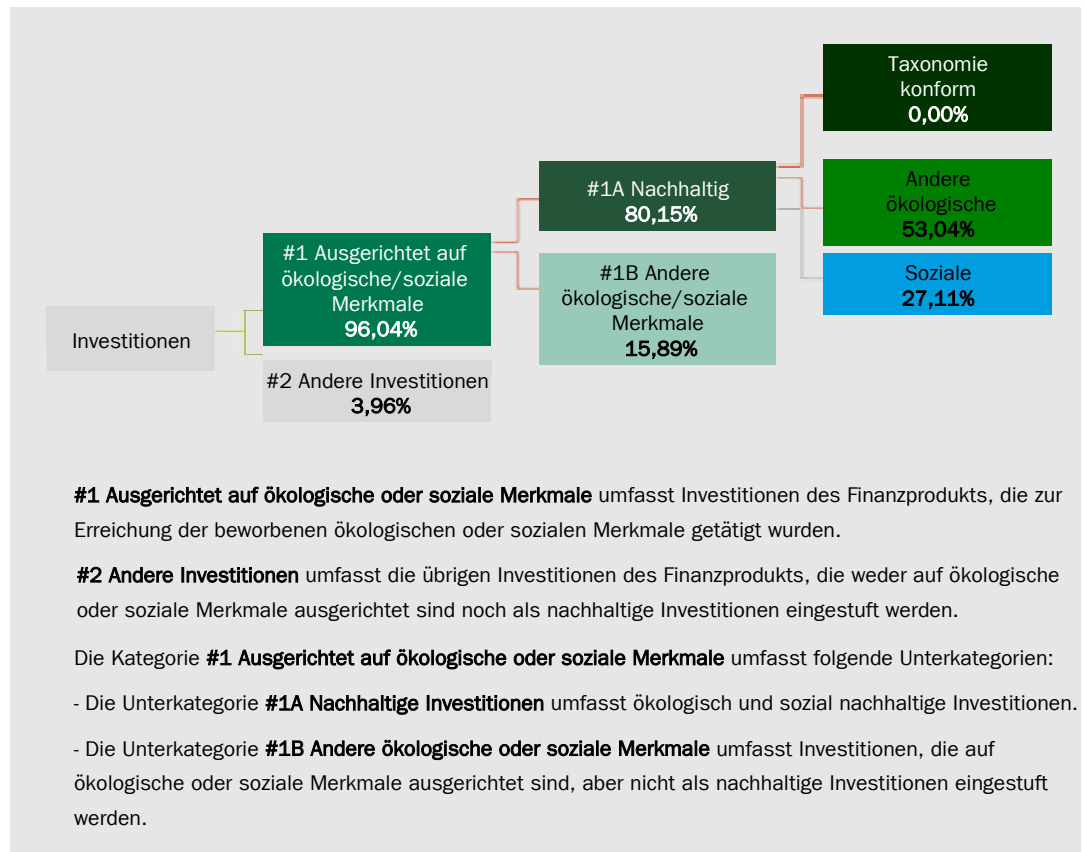


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 80,15%. 53,04% der Investitionen des Finanzprodukts waren ökologisch nachhaltige Investitionen, und 27,11% der Investitionen des Finanzprodukts waren sozial nachhaltige Investitionen. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Bezeichnung des Sektors	Anteil der Investitionen
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Bekleidung	10,36%
Handel mit Kraftfahrzeugen; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen – Versand- und Internet-Einzelhandel	9,95%
Information und Kommunikation – Verlegen von sonstiger Software	6,43%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von elektronischen Bauelementen	5,91%
Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen – Einzelhandel (ohne Handel mit Kraftfahrzeugen)	5,66%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von pharmazeutischen Erzeugnissen	5,27%
Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie – Gastronomie	5,13%
Information und Kommunikation – Informationsdienstleistungen	4,64%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Fondsmanagement	3,85%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Körperpflegemitteln und Duftstoffen	3,62%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Automobilen und Automobilteilen	3,49%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Mit Finanz- und Versicherungsdienstleistungen verbundene Tätigkeiten (ohne Versicherungen und Pensionskassen)	3,41%
Information und Kommunikation – Webportale	3,34%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von sonstiger Oberbekleidung	2,55%
Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen – Erbringung sonstiger Reservierungsdienstleistungen	2,54%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von sonstigen organischen Grundstoffen und Chemikalien	2,42%
Kunst, Unterhaltung und Erholung – Erbringung von Dienstleistungen des Sports, der Unterhaltung und der Erholung	2,34%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Geräten und Einrichtungen der Telekommunikationstechnik	2,26%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Nahrungs- und Futtermitteln	2,04%
Andere	14,79%

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** enthalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend; dieses Finanzprodukt hat sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel verpflichtet, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

● **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert(1)?**

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

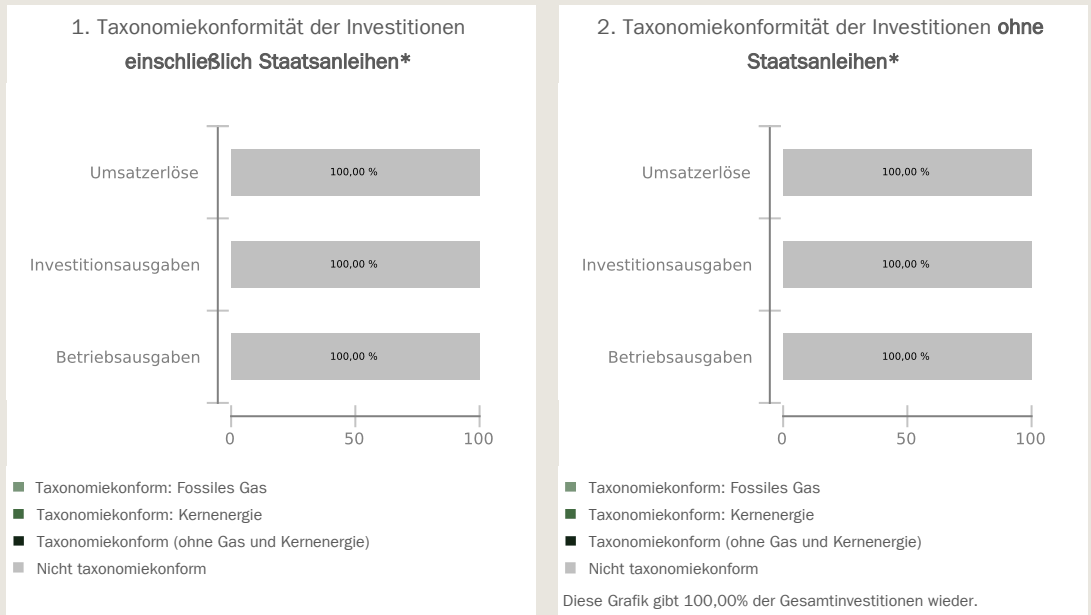
Nein

(1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind: 0,00%

Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind: 0,00%

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen	Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen (J-1)
0,00%	0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden: 53,04%

Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein; allerdings ist der Anlageverwalter gegenwärtig nicht in der Lage, den Anteil der zugrundeliegenden Investitionen des Finanzprodukts, berechnet gemäß der EU-Taxonomie, genau anzugeben. Diese Position wird jedoch weiterhin geprüft, während die zugrundeliegenden Regelungen im Laufe der Zeit fertiggestellt und mehr zuverlässige Daten verfügbar werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen: 27,11%



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts folgte einem rigorosen Verfahren, bei dem durchgängig ESG-Aspekte berücksichtigt wurden. Der Anlageverwalter wendete bei seiner Strategie die folgenden verbindlichen Kriterien an:

(a) Ausschluss von Anlagen in umstrittenen Geschäftsaktivitäten gemäß den Ausschlussrichtlinien von JSS;

(b) Erreichung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte nicht in mit C oder D bewertete Emittenten.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Name des Produkts: JSS Investmentfonds SICAV – JSS Sustainable Equity – Tech Disruptors
 Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300SQTZQN0X1QH054

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja		<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein	
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 69,65% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/>	Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/>		<input type="checkbox"/>	Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt integriert umweltbezogene, soziale und die Unternehmensführung betreffende Aspekte („ESG“) in den Investitionsprozess mit dem Ziel, ein überdurchschnittlich gutes ESG-Profil für das gesamte Portfolio gemäß der von J. Safra Sarasin („JSS“) entwickelten Nachhaltigkeitsmatrix zu erreichen.

Das ESG-Rating von JSS bewertet die Emittenten im Verhältnis zu ihrer Vergleichsgruppe und reicht von A für Emittenten, die in die Spitzenklasse eingestuft werden, bis zu D für Emittenten, die ggf. eine umstrittene Geschäftstätigkeit ausüben. Beim nachhaltigen Investieren werden Emittenten, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und bei denen die Wahrscheinlichkeit für erhebliche Beeinträchtigungen daher erhöht ist, mit C (schlechteste Leistung im Branchenvergleich) oder D (wegen umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse von Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, die Kreditratings von Staaten unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien zu analysieren. JSS misst die nachhaltige Wirtschaftsleistung eines Landes nach (i) der Verfügbarkeit von natürlichen Ressourcen und (ii) danach, wie effizient diese eingesetzt werden. Die Nachhaltigkeitsbewertungen von Ländern stellen ein ergänzendes Instrument der finanziellen Analyse ihrer Kreditratings dar.

Folgende Ausschlusskriterien (mit Umsatzschwellen) wurden im Berichtszeitraum auf das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Waffenarten, die angesichts ihrer langfristigen humanitären Folgen und/oder der großen Anzahl ziviler Opfer bei ihrem Einsatz als umstritten

eingestuft werden. Dazu zählen u. a. biologische, chemische und atomare Waffen, Streumunition und Anti-Personenminen (Umsatzschwelle: 0%);

- Verteidigung und Rüstung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und wesentliche Bauteile) sowie Hilfssysteme und Dienstleistungen im Zusammenhang mit Waffen (Waffeneinsatzsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5%);

- Kohle: Unternehmen, die in erheblichem Umfang im Kohlegeschäft tätig sind und zugleich keine solide Strategie für den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft vorweisen können (Umsatzschwelle: 5% für den Kohlebergbau, 10% für die Kohleverstromung sowie 10% für die Summe aus beiden Komponenten);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen zwecks landwirtschaftlicher Nutzung gentechnisch verändern (Umsatzschwelle: 0%);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0%);

- Tabak: Hersteller von Tabakprodukten (Umsatzschwelle: 5%);

- Erwachsenenunterhaltung: Produzenten von Erwachsenenunterhaltung (Umsatzschwelle: 5%);

- Verstöße gegen Menschenrechte und sonstige Prinzipien des Global Compact: Unternehmen, die nach Maßgabe anerkannter internationaler Standards an schweren Verstößen gegen Menschenrechte oder sonstige Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen beteiligt sind (Umsatzschwelle: 0%).

- Palmöl: Unternehmen mit einem Bezug zu Palmöl ohne ausreichende Zertifizierung durch den Roundtable on Sustainable Palm Oil („RSPO“) werden ausgeschlossen (Umsatzschwelle: 5% für Palmölproduzenten, wenn weniger als 75% der Standorte eine RSPO-Zertifizierung besitzen).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Zeitpunkt dar. Bei nachhaltigen Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem sozialen Ziel beitragen, wird davon ausgegangen, dass sie zu beiden gleichermaßen beitragen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● *Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?*

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	94
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	6

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators (J-1)
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	94	93
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	6	7

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der CO₂-Emissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren Zielen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) in Einklang stehen, oder durch die Einnahme einer Spitzenposition im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren innerhalb der Vergleichsgruppe.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Prüfung auf erhebliche Beeinträchtigungen (Do no significant harm, „DSNH“) schließt Emittenten aus, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellenwerte der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen nicht erreichen. Ein Emittent besteht die Prüfung, wenn er nach der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Bewertung A oder B erhält. Wenn der Emittent im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist, muss er außerdem über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügen, um die Prüfung zu bestehen. Zu den Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen gehören Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie Kraftwerks- und Koks Kohle.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen nach Maßgabe der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen im Rahmen des Investitionsprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten negativen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Investitionen erreicht, die die ökologischen oder sozialen Mindestschwellenwerte nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Mitwirkungsmaßnahmen dienen der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Die Definition des ESG-Auswahlverfahrens und Anlageuniversums beruht auf den

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Richtlinien und der Strategie von JSS für nachhaltiges Investieren, in denen die Prinzipien mehrerer internationaler Übereinkommen und Normen enthalten sind, u. a.:

Die Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen,

Die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

Der Global Compact der Vereinten Nationen,

Die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

Die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

Die Grundsätze zu Kinderrechten und unternehmerischem Handeln,

Die Arbeitsstandards der ILO,

Die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

Das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

Das Übereinkommen über Streumunition.

Der ESG-Auswahlprozess trägt dazu bei, börsennotierte Unternehmen zu ermitteln, die vermeintlich gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung verstoßen, wie in den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte vorgesehen. Diese Unternehmen werden als unvereinbar mit den o. a. Prinzipien erachtet und aus dem Universum nachhaltiger Investitionen von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Unternehmen

THG-Emissionen, CO₂-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind, Anteil des Verbrauchs und der Erzeugung von nicht erneuerbaren Energien, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (berücksichtigt für Ausschlüsse, Klimaversprechen und innerhalb der Nachhaltigkeitsmatrix)

Die schädlichsten Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe werden ausgeschlossen. Seit dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Umsätze aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 10\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 10\%$ aus einer Kombination aus dem Kraftwerkskohlebergbau und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

In Sektoren, in denen CO₂-Emissionen einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine CO₂-Emissionen. Dies umfasst eine Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Senkung der Emissionsintensität seines Kerngeschäfts, zur Senkung seines künftigen Energieverbrauchs oder seiner Treibhausgasemissionen (Scope 1, 2 und 3).

In Sektoren, in denen Möglichkeiten im Bereich der erneuerbaren Energien einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf erneuerbare Energien. Hierzu zählt auch die Bewertung der Kapazität eines Unternehmens im Bereich der erneuerbaren Energien.

Im Mai 2020 hat JSS ein Klimaversprechen abgegeben, das auf Klimaneutralität bis zum Jahr 2035 abzielt. Bei Fonds, bei denen dieses Versprechen bereits umgesetzt wurde, werden Treibhausgasemissionen anhand des CO₂-Fußabdrucks überwacht; diese Kontrollen werden für eine Teilmenge der Fonds durchgeführt. Die Einhaltung des Klimaversprechens wird mithilfe rückwärtsgerichteter Dekarbonisierungspfade überprüft, mit denen Übergangsrisiken gemindert werden sollen. Die meisten Fonds, die das Klimaversprechen umgesetzt haben, wenden folgende Methode an: Das ursprüngliche Ziel entspricht einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen des Referenzwerts um 30%. Diese Zielvorgabe wird in den folgenden Jahren um 7% verringert. Ab 2030 wird das Ziel linear gesenkt, bis das Netto-Null-Ziel im Jahr 2035 schließlich erreicht wird. Die THG-Emissionen des Portfolios auf der Grundlage der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro Mio. USD des Unternehmenswertes (EVIC) ausgedrückt.

Tätigkeiten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung wesentliche ESG-Faktoren darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf Biodiversität und Landnutzung. Hierzu zählt auch eine Bewertung der Auswirkungen der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens auf die Biodiversität. Zudem wird Palmöl konsequent ausgeschlossen.

Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Emissionen in Wasser (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Emissionen in Wasser erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Wasserbewirtschaftung. Die Wasserbewirtschaftung umfasst eine Bewertung wassereffizienter Produktionsprozesse, Trends bei der Wasserintensität sowie messbare, zeitlich befristete Zielvorgaben zur Senkung des Wasserverbrauchs. Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Gefährlicher Abfall (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Schadstoffemissionen und schädlichen Abfällen erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Schadstoffemissionen und seine Abfallwirtschaft. Der Umgang mit Schadstoffemissionen umfasst eine Bewertung der Bemühungen zur Kontrolle und Verringerung der Menge giftiger und krebserregender Nebenprodukte im Rahmen der Geschäftstätigkeit, Trends bei der Schadstofffreisetzung sowie messbare, zeitlich begrenzte Zielvorgaben zur Reduzierung von Schadstoffemissionen.

Verstöße gegen UNGC-Grundsätze (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Fehlende Prozesse zur Überwachung der Einhaltung des UNGC

Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Bestandteil der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Investitionsprozess einbeziehen, sobald die Offenlegungsquoten ausreichend

sind. In der Zwischenzeit erfolgt eine ESG-Überwachung, bei der unter anderem regelmäßige Screenings auf Verstöße gegen die UNGC-Vorgaben durchgeführt werden. JSS strebt eine Berücksichtigung dieses Indikators an, sobald sich die Datenzuverlässigkeit und -verfügbarkeit verbessern.

Engagement in umstrittenen Waffen (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS wird seiner Verantwortung in Bezug auf umstrittene Waffen aktiv gerecht, indem es sie konzernweit ausschließt. JSS investiert keine Eigenmittel in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich der umstrittenen Waffen tätig sind. Ferner übernimmt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für solche Unternehmen bzw. keine Dienstleistungen im Zusammenhang mit Kapitalmärkten oder Fusionen und Übernahmen.

Staaten

THG-Emissionsintensität (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die externen Umweltkosten eines Landes. Bewertet werden unter anderem die Treibhausgasemissionen pro Kopf.

Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Landes in Bezug auf Grundrechte.



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 – 30.06.2024

Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORP	Information und Kommunikation	9,51	US
NVIDIA CORP	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	8,73	US
ALPHABET INC-CL A	Information und Kommunikation	6,43	US
APPLE INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,71	US
AMAZON.COM INC	Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	4,71	US
SERVICENOW INC	Information und Kommunikation	4,43	US
APPLIED MATERIALS INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	4,36	US
SAMSUNG ELECTR-GDR REG S	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,48	KR
ONTO INNOVATION INC	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,22	US
SYNOPSIS INC	Information und Kommunikation	3,22	US

Hauptinvestitionen per 30.06.2024 (Ende des Geschäftsjahres). Keine bedeutenden Abweichungen über das Geschäftsjahr.

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

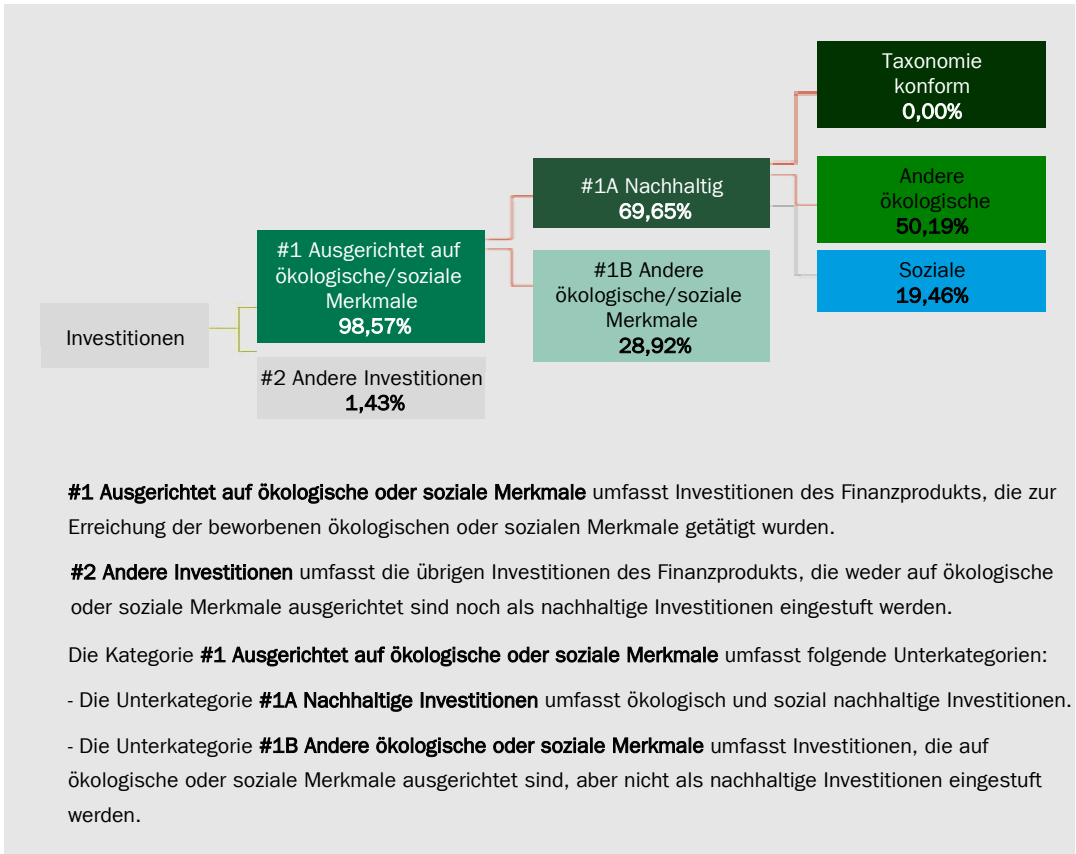


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 69,65%. 50,19% der Investitionen des Finanzprodukts waren ökologisch nachhaltige Investitionen, und 19,46% der Investitionen des Finanzprodukts waren sozial nachhaltige Investitionen. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.



Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Bezeichnung des Sektors	Anteil der Investitionen
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	20,97%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von elektronischen Bauelementen	15,34%
Information und Kommunikation – Verlegen von sonstiger Software	12,87%
Information und Kommunikation – Verlagswesen	8,97%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Geräten und Einrichtungen der Telekommunikationstechnik	7,09%
Information und Kommunikation – Webportale	6,43%
Handel mit Kraftfahrzeugen; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen – Versand- und Internet-Einzelhandel	4,71%
Information und Kommunikation – Programmierungstätigkeiten	4,43%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Maschinenbau	3,90%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von optischen und fotografischen Instrumenten und Geräten	3,14%
Information und Kommunikation – Informationsdienstleistungen	2,54%
Information und Kommunikation – Sonstiges Verlagswesen (ohne Software)	1,80%
Information und Kommunikation – Fernsehveranstalter	1,72%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	1,62%
Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen – Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	1,50%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Beteiligungsgesellschaften	1,40%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Sonstige Kreditinstitute (ohne Spezialkreditinstitute)	1,27%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Hebezeugen und Fördermitteln	0,31%

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** enthalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend; dieses Finanzprodukt hat sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel verpflichtet, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert(1)?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

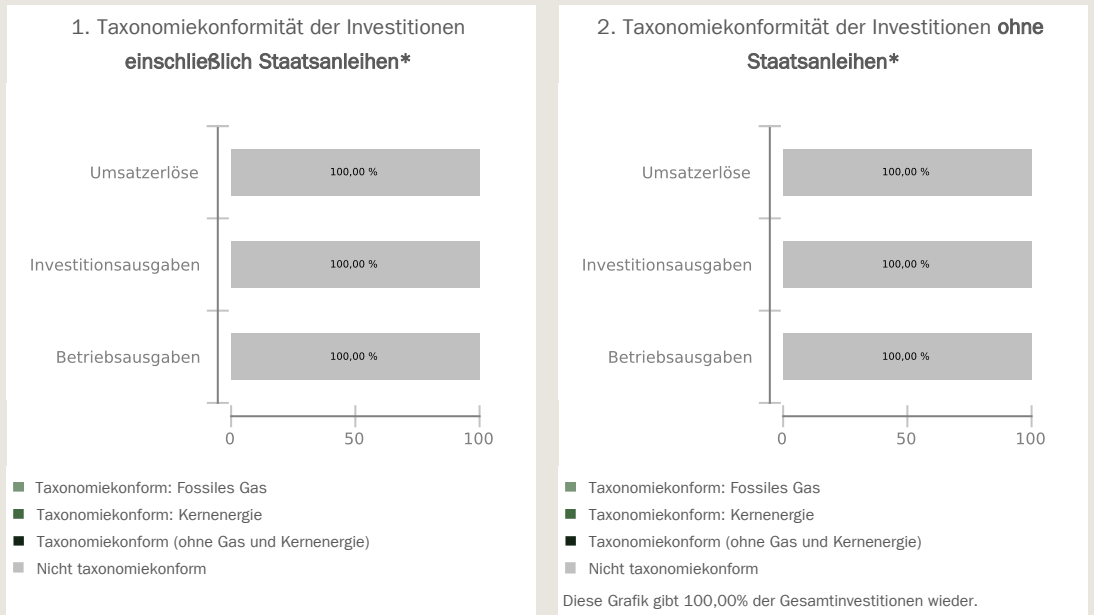
Nein

(1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind: 0,00%

Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind: 0,00%

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen	Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen (J-1)
0,00%	0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden: 50,19%

Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein; allerdings ist der Anlageverwalter gegenwärtig nicht in der Lage, den Anteil der zugrundeliegenden Investitionen des Finanzprodukts, berechnet gemäß der EU-Taxonomie, genau anzugeben. Diese Position wird jedoch weiterhin geprüft, während die zugrundeliegenden Regelungen im Laufe der Zeit fertiggestellt und mehr zuverlässige Daten verfügbar werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen: 19,46%



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts folgte einem rigorosen Verfahren, bei dem durchgängig ESG-Aspekte berücksichtigt wurden. Der Anlageverwalter wendete bei seiner Strategie die folgenden verbindlichen Kriterien an:

(a) Ausschluss von Anlagen in umstrittenen Geschäftsaktivitäten gemäß den Ausschlussrichtlinien von JSS;

(b) Erreichung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte nicht in mit C oder D bewertete Emittenten.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Name des Produkts: JSS Investmentfonds SICAV – JSS Sustainable Bond – Emerging Markets Local
Currency

Unternehmenskennung (LEI-Code): 5493009TYM1SZ3ZRZ921

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 57,86% an nachhaltigen Investitionen
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt integriert umweltbezogene, soziale und die Unternehmensführung betreffende Aspekte („ESG“) in den Investitionsprozess mit dem Ziel, ein überdurchschnittlich gutes ESG-Profil für das gesamte Portfolio gemäß der von J. Safra Sarasin („JSS“) entwickelten Nachhaltigkeitsmatrix zu erreichen.

Das ESG-Rating von JSS bewertet die Emittenten im Verhältnis zu ihrer Vergleichsgruppe und reicht von A für Emittenten, die in die Spitzenklasse eingestuft werden, bis zu D für Emittenten, die ggf. eine umstrittene Geschäftstätigkeit ausüben. Beim nachhaltigen Investieren werden Emittenten, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und bei denen die Wahrscheinlichkeit für erhebliche Beeinträchtigungen daher erhöht ist, mit C (schlechteste Leistung im Branchenvergleich) oder D (wegen umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse von Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, die Kreditratings von Staaten unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien zu analysieren. JSS misst die nachhaltige Wirtschaftsleistung eines Landes nach (i) der Verfügbarkeit von natürlichen Ressourcen und (ii) danach, wie effizient diese eingesetzt werden. Die Nachhaltigkeitsbewertungen von Ländern stellen ein ergänzendes Instrument der finanziellen Analyse ihrer Kreditratings dar.

Folgende Ausschlusskriterien (mit Umsatzschwellen) wurden im Berichtszeitraum auf das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Waffenarten, die angesichts ihrer langfristigen

humanitären Folgen und/oder der großen Anzahl ziviler Opfer bei ihrem Einsatz als umstritten eingestuft werden. Dazu zählen u. a. biologische, chemische und atomare Waffen, Streumunition und Anti-Personenminen (Umsatzschwelle: 0%);

- Verteidigung und Rüstung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und wesentliche Bauteile) sowie Hilfssysteme und Dienstleistungen im Zusammenhang mit Waffen (Waffeneinsatzsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5%);

- Kohle: Unternehmen, die in erheblichem Umfang im Kohlegeschäft tätig sind und zugleich keine solide Strategie für den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft vorweisen können (Umsatzschwelle: 5% für den Kohlebergbau, 10% für die Kohleverstromung sowie 10% für die Summe aus beiden Komponenten);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen zwecks landwirtschaftlicher Nutzung gentechnisch verändern (Umsatzschwelle: 0%);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0%);

- Tabak: Hersteller von Tabakprodukten (Umsatzschwelle: 5%);

- Erwachsenenunterhaltung: Produzenten von Erwachsenenunterhaltung (Umsatzschwelle: 5%);

- Verstöße gegen Menschenrechte und sonstige Prinzipien des Global Compact: Unternehmen, die nach Maßgabe anerkannter internationaler Standards an schweren Verstößen gegen Menschenrechte oder sonstige Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen beteiligt sind (Umsatzschwelle: 0%).

- Palmöl: Unternehmen mit einem Bezug zu Palmöl ohne ausreichende Zertifizierung durch den Roundtable on Sustainable Palm Oil („RSPO“) werden ausgeschlossen (Umsatzschwelle: 5% für Palmölproduzenten, wenn weniger als 75% der Standorte eine RSPO-Zertifizierung besitzen).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Zeitpunkt dar. Bei nachhaltigen Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem sozialen Ziel beitragen, wird davon ausgegangen, dass sie zu beiden gleichermaßen beitragen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● *Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?*

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	64
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	36

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators (J-1)
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	64	47
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	36	45

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der CO₂-Emissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren Zielen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) in Einklang stehen, oder durch die Einnahme einer Spitzenposition im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren innerhalb der Vergleichsgruppe.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Prüfung auf erhebliche Beeinträchtigungen (Do no significant harm, „DSNH“) schließt Emittenten aus, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellenwerte der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen nicht erreichen. Ein Emittent besteht die Prüfung, wenn er nach der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Bewertung A oder B erhält. Wenn der Emittent im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist, muss er außerdem über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügen, um die Prüfung zu bestehen. Zu den Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen gehören Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie Kraftwerks- und Koks Kohle.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen nach Maßgabe der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen im Rahmen des Investitionsprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten negativen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Investitionen erreicht, die die ökologischen oder sozialen Mindestschwellenwerte nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Mitwirkungsmaßnahmen dienen der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Die Definition des ESG-Auswahlverfahrens und Anlageuniversums beruht auf den

Richtlinien und der Strategie von JSS für nachhaltiges Investieren, in denen die Prinzipien mehrerer internationaler Übereinkommen und Normen enthalten sind, u. a.:

Die Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen,

Die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

Der Global Compact der Vereinten Nationen,

Die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

Die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

Die Grundsätze zu Kinderrechten und unternehmerischem Handeln,

Die Arbeitsstandards der ILO,

Die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

Das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

Das Übereinkommen über Streumunition.

Der ESG-Auswahlprozess trägt dazu bei, börsennotierte Unternehmen zu ermitteln, die vermeintlich gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung verstoßen, wie in den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte vorgesehen. Diese Unternehmen werden als unvereinbar mit den o. a. Prinzipien erachtet und aus dem Universum nachhaltiger Investitionen von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Unternehmen

THG-Emissionen, CO₂-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind, Anteil des Verbrauchs und der Erzeugung von nicht erneuerbaren Energien, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (berücksichtigt für Ausschlüsse, Klimaversprechen und innerhalb der Nachhaltigkeitsmatrix)

Die schädlichsten Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe werden ausgeschlossen. Seit dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Umsätze aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 10\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 10\%$ aus einer Kombination aus dem Kraftwerkskohlebergbau und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

In Sektoren, in denen CO₂-Emissionen einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine CO₂-Emissionen. Dies umfasst eine Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Senkung der Emissionsintensität seines Kerngeschäfts, zur Senkung seines künftigen Energieverbrauchs oder seiner Treibhausgasemissionen (Scope 1, 2 und 3).

In Sektoren, in denen Möglichkeiten im Bereich der erneuerbaren Energien einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf erneuerbare Energien. Hierzu zählt auch die Bewertung der Kapazität eines Unternehmens im Bereich der erneuerbaren Energien.

Im Mai 2020 hat JSS ein Klimaversprechen abgegeben, das auf Klimaneutralität bis zum Jahr 2035 abzielt. Bei Fonds, bei denen dieses Versprechen bereits umgesetzt wurde, werden Treibhausgasemissionen anhand des CO₂-Fußabdrucks überwacht; diese Kontrollen werden für eine Teilmenge der Fonds durchgeführt. Die Einhaltung des Klimaversprechens wird mithilfe rückwärtsgerichteter Dekarbonisierungspfade überprüft, mit denen Übergangsrisiken gemindert werden sollen. Die meisten Fonds, die das Klimaversprechen umgesetzt haben, wenden folgende Methode an: Das ursprüngliche Ziel entspricht einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen des Referenzwerts um 30%. Diese Zielvorgabe wird in den folgenden Jahren um 7% verringert. Ab 2030 wird das Ziel linear gesenkt, bis das Netto-Null-Ziel im Jahr 2035 schließlich erreicht wird. Die THG-Emissionen des Portfolios auf der Grundlage der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro Mio. USD des Unternehmenswertes (EVIC) ausgedrückt.

Tätigkeiten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung wesentliche ESG-Faktoren darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf Biodiversität und Landnutzung. Hierzu zählt auch eine Bewertung der Auswirkungen der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens auf die Biodiversität. Zudem wird Palmöl konsequent ausgeschlossen.

Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Emissionen in Wasser (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Emissionen in Wasser erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Wasserbewirtschaftung. Die Wasserbewirtschaftung umfasst eine Bewertung wassereffizienter Produktionsprozesse, Trends bei der Wasserintensität sowie messbare, zeitlich befristete Zielvorgaben zur Senkung des Wasserverbrauchs. Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Gefährlicher Abfall (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Schadstoffemissionen und schädlichen Abfällen erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Schadstoffemissionen und seine Abfallwirtschaft. Der Umgang mit Schadstoffemissionen umfasst eine Bewertung der Bemühungen zur Kontrolle und Verringerung der Menge giftiger und krebserregender Nebenprodukte im Rahmen der Geschäftstätigkeit, Trends bei der Schadstofffreisetzung sowie messbare, zeitlich begrenzte Zielvorgaben zur Reduzierung von Schadstoffemissionen.

Verstöße gegen UNGC-Grundsätze (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Fehlende Prozesse zur Überwachung der Einhaltung des UNGC

Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Bestandteil der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Investitionsprozess einbeziehen, sobald die Offenlegungsquoten ausreichend

sind. In der Zwischenzeit erfolgt eine ESG-Überwachung, bei der unter anderem regelmäßige Screenings auf Verstöße gegen die UNGC-Vorgaben durchgeführt werden. JSS strebt eine Berücksichtigung dieses Indikators an, sobald sich die Datenzuverlässigkeit und -verfügbarkeit verbessern.

Engagement in umstrittenen Waffen (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS wird seiner Verantwortung in Bezug auf umstrittene Waffen aktiv gerecht, indem es sie konzernweit ausschließt. JSS investiert keine Eigenmittel in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich der umstrittenen Waffen tätig sind. Ferner übernimmt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für solche Unternehmen bzw. keine Dienstleistungen im Zusammenhang mit Kapitalmärkten oder Fusionen und Übernahmen.

Staaten

THG-Emissionsintensität (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die externen Umweltkosten eines Landes. Bewertet werden unter anderem die Treibhausgasemissionen pro Kopf.

Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Landes in Bezug auf Grundrechte.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel:**
01.07.2023 – 30.06.2024

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
TSCHECHISCHE REPUBLIK	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	9,85	CZ
STAATSANLEIHE POLEN	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	9,80	PL
KOLUMBIEN	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	8,31	CO
SCHATZWECHSEL	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	7,71	US
TSCHECHISCHE REPUBLIK	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	7,39	CZ
MEX BONOS DESARR FIX RT	Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	7,09	MX

Hauptinvestitionen per 30.06.2024 (Ende des Geschäftsjahres). Keine bedeutenden Abweichungen über das Geschäftsjahr.

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Die Gewichtung von Anleihen wird ermittelt, indem der Marktpreis der Anleihe (einschließlich aufgelaufener Zinsen) durch das Gesamtvermögen des Teilfonds geteilt wird.

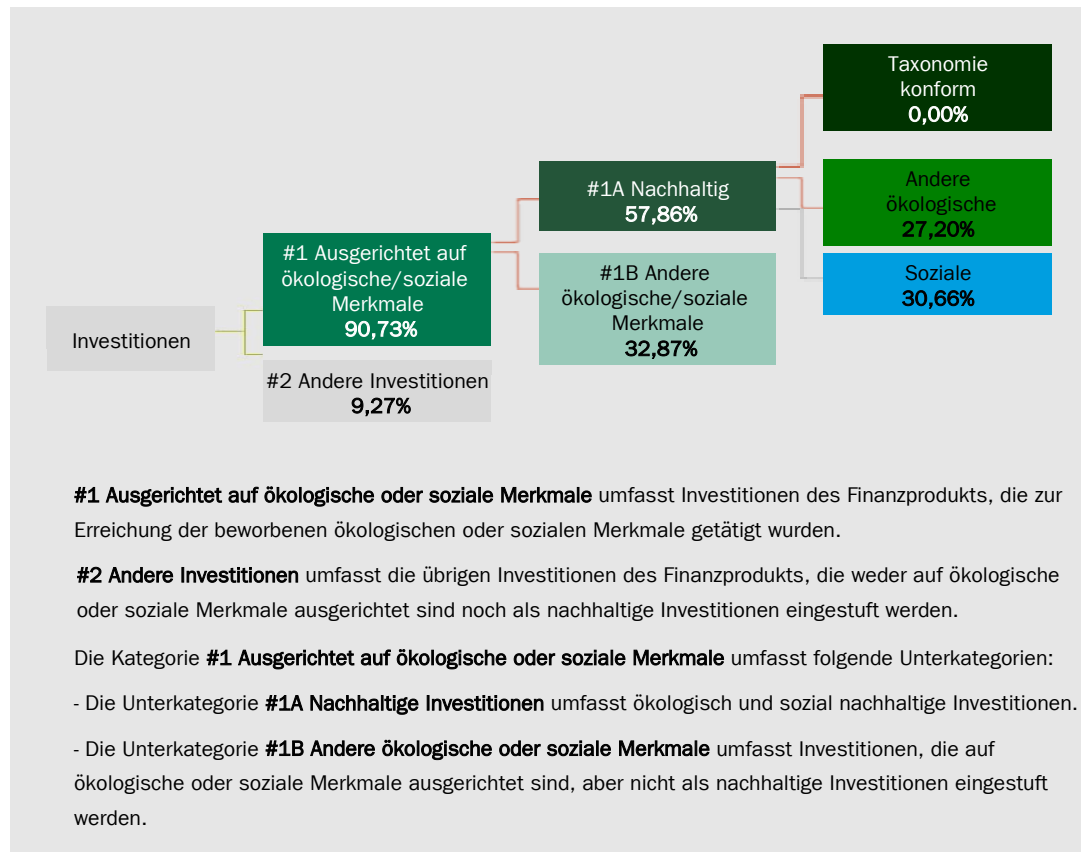


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 57,86%. 27,2% der Investitionen des Finanzprodukts waren ökologisch nachhaltige Investitionen, und 30,66% der Investitionen des Finanzprodukts waren sozial nachhaltige Investitionen. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Bezeichnung des Sektors	Anteil der Investitionen
Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung – Öffentliche Verwaltung und Verteidigung; Sozialversicherung	87,49%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Sonstige Kreditinstitute (ohne Spezialkreditinstitute)	9,03%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Dienstleistungen des Effekten- und Warenhandels	3,48%

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** enthalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend; dieses Finanzprodukt hat sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel verpflichtet, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert(1)?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

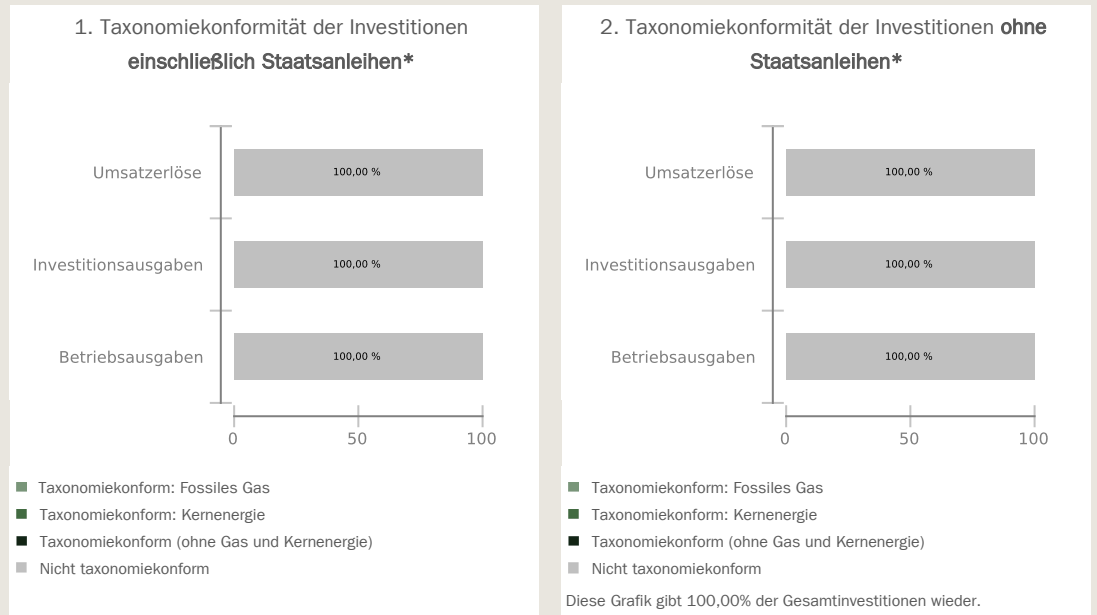
Nein

(1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind: 0,00%

Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind: 0,00%

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen	Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen (J-1)
0,00%	0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden: 27,20%

Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein; allerdings ist der Anlageverwalter gegenwärtig nicht in der Lage, den Anteil der zugrundeliegenden Investitionen des Finanzprodukts, berechnet gemäß der EU-Taxonomie, genau anzugeben. Diese Position wird jedoch weiterhin geprüft, während die zugrundeliegenden Regelungen im Laufe der Zeit fertiggestellt und mehr zuverlässige Daten verfügbar werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen: 30,66%



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts folgte einem rigorosen Verfahren, bei dem durchgängig ESG-Aspekte berücksichtigt wurden. Der Anlageverwalter wendete bei seiner Strategie die folgenden verbindlichen Kriterien an:

(a) Ausschluss von Anlagen in umstrittenen Geschäftsaktivitäten gemäß den Ausschlussrichtlinien von JSS;

(b) Erreichung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte nicht in mit C oder D bewertete Emittenten.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Name des Produkts: JSS Investmentfonds SICAV – JSS Sustainable Equity – Swiss SME Plus
 Unternehmenskennung (LEI-Code): 5299008EQX0ETOPARD57

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Ja	<input checked="" type="radio"/> <input type="radio"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : __% <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : __%	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 38,54% an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Dieses Produkt integriert umweltbezogene, soziale und die Unternehmensführung betreffende Aspekte („ESG“) in den Investitionsprozess mit dem Ziel, ein überdurchschnittlich gutes ESG-Profil für das gesamte Portfolio gemäß der von J. Safra Sarasin („JSS“) entwickelten Nachhaltigkeitsmatrix zu erreichen.

Das ESG-Rating von JSS bewertet die Emittenten im Verhältnis zu ihrer Vergleichsgruppe und reicht von A für Emittenten, die in die Spitzenklasse eingestuft werden, bis zu D für Emittenten, die ggf. eine umstrittene Geschäftstätigkeit ausüben. Beim nachhaltigen Investieren werden Emittenten, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und bei denen die Wahrscheinlichkeit für erhebliche Beeinträchtigungen daher erhöht ist, mit C (schlechteste Leistung im Branchenvergleich) oder D (wegen umstrittener Geschäftsaktivitäten ausgeschlossen) bewertet. Die Analyse von Nachhaltigkeitsfaktoren erstreckt sich auch auf Länder, was es JSS ermöglicht, die Kreditratings von Staaten unter Berücksichtigung von ESG-Kriterien zu analysieren. JSS misst die nachhaltige Wirtschaftsleistung eines Landes nach (i) der Verfügbarkeit von natürlichen Ressourcen und (ii) danach, wie effizient diese eingesetzt werden. Die Nachhaltigkeitsbewertungen von Ländern stellen ein ergänzendes Instrument der finanziellen Analyse ihrer Kreditratings dar.

Folgende Ausschlusskriterien (mit Umsatzschwellen) wurden im Berichtszeitraum auf das Produkt angewendet:

- Umstrittene Waffen: Umstrittene Waffen sind Waffenarten, die angesichts ihrer langfristigen humanitären Folgen und/oder der großen Anzahl ziviler Opfer bei ihrem Einsatz als umstritten

eingestuft werden. Dazu zählen u. a. biologische, chemische und atomare Waffen, Streumunition und Anti-Personenminen (Umsatzschwelle: 0%);

- Verteidigung und Rüstung: Hersteller ziviler Schusswaffen, konventioneller Waffen (Systeme und wesentliche Bauteile) sowie Hilfssysteme und Dienstleistungen im Zusammenhang mit Waffen (Waffeneinsatzsysteme, Zielnavigationssysteme usw.) (Umsatzschwelle: 5%);

- Kohle: Unternehmen, die in erheblichem Umfang im Kohlegeschäft tätig sind und zugleich keine solide Strategie für den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft vorweisen können (Umsatzschwelle: 5% für den Kohlebergbau, 10% für die Kohleverstromung sowie 10% für die Summe aus beiden Komponenten);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Landwirtschaft: Unternehmen, die Organismen zwecks landwirtschaftlicher Nutzung gentechnisch verändern (Umsatzschwelle: 0%);

- Gentechnisch veränderte Organismen in der Medizin: Klonen von Menschen und sonstige Manipulationen der menschlichen Keimbahn (Umsatzschwelle: 0%);

- Tabak: Hersteller von Tabakprodukten (Umsatzschwelle: 5%);

- Erwachsenenunterhaltung: Produzenten von Erwachsenenunterhaltung (Umsatzschwelle: 5%);

- Verstöße gegen Menschenrechte und sonstige Prinzipien des Global Compact: Unternehmen, die nach Maßgabe anerkannter internationaler Standards an schweren Verstößen gegen Menschenrechte oder sonstige Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen beteiligt sind (Umsatzschwelle: 0%).

- Palmöl: Unternehmen mit einem Bezug zu Palmöl ohne ausreichende Zertifizierung durch den Roundtable on Sustainable Palm Oil („RSPO“) werden ausgeschlossen (Umsatzschwelle: 5% für Palmölproduzenten, wenn weniger als 75% der Standorte eine RSPO-Zertifizierung besitzen).

Alle Zahlen in diesem Dokument werden zum Ende des Berichtszeitraums berechnet und stellen das Modellportfolio zu diesem Zeitpunkt dar. Bei nachhaltigen Investitionen, die sowohl zu einem ökologischen als auch zu einem sozialen Ziel beitragen, wird davon ausgegangen, dass sie zu beiden gleichermaßen beitragen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● *Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?*

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	77
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	23

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Bezeichnung des Nachhaltigkeitsindikators	Einheit des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators	Wert des Nachhaltigkeitsindikators (J-1)
Anteil von mit A bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	77	
Anteil von mit B bewerteten Investitionen (ohne Barmittel und andere)	Prozentualer Anteil	23	

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Produkts trugen zu ökologischen und/oder sozialen Zielen bei, darunter die Reduzierung der CO₂-Emissionen, die Erhöhung der Biodiversität, die Bekämpfung von Ungleichheit und die Förderung des sozialen Zusammenhalts.

Der Beitrag der nachhaltigen Investitionen zu den ökologischen und/oder sozialen Zielen wurde durch die Generierung von Umsätzen erreicht, die mit einem oder mehreren Zielen für nachhaltige Entwicklung (SDGs) in Einklang stehen, oder durch die Einnahme einer Spitzenposition im Hinblick auf wesentliche ökologische und/oder soziale Indikatoren innerhalb der Vergleichsgruppe.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Prüfung auf erhebliche Beeinträchtigungen (Do no significant harm, „DSNH“) schließt Emittenten aus, die im Wesentlichen nicht auf nachhaltige Praktiken ausgerichtet sind und/oder die Mindestschwellenwerte der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen nicht erreichen. Ein Emittent besteht die Prüfung, wenn er nach der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Bewertung A oder B erhält. Wenn der Emittent im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig ist, muss er außerdem über ein genehmigtes SBTi-Ziel verfügen, um die Prüfung zu bestehen. Zu den Tätigkeiten im Zusammenhang mit fossilen Brennstoffen gehören Gewinnung, Verarbeitung, Lagerung und Transport von Erdölprodukten, Erdgas sowie Kraftwerks- und Koks Kohle.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter war verpflichtet, die negativen Folgen seiner Anlageentscheidungen nach Maßgabe der Indikatoren für nachteilige Auswirkungen im Rahmen des Investitionsprozesses zu berücksichtigen. Der Anlageverwalter berücksichtigte mindestens die obligatorischen wichtigsten negativen Auswirkungen, je nach Datenverfügbarkeit und -qualität. Dies wurde durch den Ausschluss von Investitionen erreicht, die die ökologischen oder sozialen Mindestschwellenwerte nicht erreichten, sowie durch den Austausch mit Unternehmen und Körperschaften, in die das Produkt investiert ist. Mitwirkungsmaßnahmen dienen der Unterstützung einer langfristigen, nachhaltigen Entwicklung, um den langfristigen Unternehmenswert durch die Förderung einer guten Unternehmensführung und einer starken sozialen und ökologischen Performance zu steigern.

Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Ja. Die Definition des ESG-Auswahlverfahrens und Anlageuniversums beruht auf den

Richtlinien und der Strategie von JSS für nachhaltiges Investieren, in denen die Prinzipien mehrerer internationaler Übereinkommen und Normen enthalten sind, u. a.:

Die Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen,

Die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte,

Der Global Compact der Vereinten Nationen,

Die OECD-Grundsätze der Corporate Governance,

Die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte,

Die Grundsätze zu Kinderrechten und unternehmerischem Handeln,

Die Arbeitsstandards der ILO,

Die Rio-Erklärung über Umwelt und Entwicklung,

Das Übereinkommen der Vereinten Nationen gegen Korruption,

Das Übereinkommen über Streumunition.

Der ESG-Auswahlprozess trägt dazu bei, börsennotierte Unternehmen zu ermitteln, die vermeintlich gegen internationale Gesetze und Normen zu Umweltschutz, Menschenrechten, Arbeitsstandards und Korruptionsbekämpfung verstoßen, wie in den Leitlinien der OECD für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte vorgesehen. Diese Unternehmen werden als unvereinbar mit den o. a. Prinzipien erachtet und aus dem Universum nachhaltiger Investitionen von JSS ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Unternehmen

THG-Emissionen, CO₂-Fußabdruck, THG-Emissionsintensität, Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind, Anteil des Verbrauchs und der Erzeugung von nicht erneuerbaren Energien, Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren (berücksichtigt für Ausschlüsse, Klimaversprechen und innerhalb der Nachhaltigkeitsmatrix)

Die schädlichsten Tätigkeiten im Bereich der fossilen Brennstoffe werden ausgeschlossen. Seit dem 01.01.2023 werden Unternehmen, die $\geq 5\%$ ihrer Umsätze aus dem Kraftwerkskohlebergbau oder $\geq 10\%$ aus der Stromzeugung aus Kraftwerkskohle oder $\geq 10\%$ aus einer Kombination aus dem Kraftwerkskohlebergbau und Stromerzeugung aus Kraftwerkskohle erzielen, aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

In Sektoren, in denen CO₂-Emissionen einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine CO₂-Emissionen. Dies umfasst eine Bewertung der Programme oder Maßnahmen eines Unternehmens zur Senkung der Emissionsintensität seines Kerngeschäfts, zur Senkung seines künftigen Energieverbrauchs oder seiner Treibhausgasemissionen (Scope 1, 2 und 3).

In Sektoren, in denen Möglichkeiten im Bereich der erneuerbaren Energien einen wesentlichen ESG-Faktor darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf erneuerbare Energien. Hierzu zählt auch die Bewertung der Kapazität eines Unternehmens im Bereich der erneuerbaren Energien.

Im Mai 2020 hat JSS ein Klimaversprechen abgegeben, das auf Klimaneutralität bis zum Jahr 2035 abzielt. Bei Fonds, bei denen dieses Versprechen bereits umgesetzt wurde, werden Treibhausgasemissionen anhand des CO₂-Fußabdrucks überwacht; diese Kontrollen werden für eine Teilmenge der Fonds durchgeführt. Die Einhaltung des Klimaversprechens wird mithilfe rückwärtsgerichteter Dekarbonisierungspfade überprüft, mit denen Übergangsrisiken gemindert werden sollen. Die meisten Fonds, die das Klimaversprechen umgesetzt haben, wenden folgende Methode an: Das ursprüngliche Ziel entspricht einer Reduzierung der Treibhausgasemissionen des Referenzwerts um 30%. Diese Zielvorgabe wird in den folgenden Jahren um 7% verringert. Ab 2030 wird das Ziel linear gesenkt, bis das Netto-Null-Ziel im Jahr 2035 schließlich erreicht wird. Die THG-Emissionen des Portfolios auf der Grundlage der Unternehmen, in die investiert wird, werden in tCO₂e pro Mio. USD des Unternehmenswertes (EVIC) ausgedrückt.

Tätigkeiten, die sich negativ auf die Biodiversität auswirken (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren, in denen Biodiversität und Landnutzung wesentliche ESG-Faktoren darstellen, erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf Biodiversität und Landnutzung. Hierzu zählt auch eine Bewertung der Auswirkungen der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens auf die Biodiversität. Zudem wird Palmöl konsequent ausgeschlossen.

Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Emissionen in Wasser (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Emissionen in Wasser erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Wasserbewirtschaftung. Die Wasserbewirtschaftung umfasst eine Bewertung wassereffizienter Produktionsprozesse, Trends bei der Wasserintensität sowie messbare, zeitlich befristete Zielvorgaben zur Senkung des Wasserverbrauchs. Hinweis: Die Datenqualität und -abdeckung für diese PAI-Messgröße sind derzeit unzureichend. Solange dies der Fall ist, ist nur eine begrenzte Berücksichtigung möglich. JSS überwacht weiterhin neue Entwicklungen und die Verfügbarkeit von Daten.

Gefährlicher Abfall (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

In Sektoren mit beträchtlichen Schadstoffemissionen und schädlichen Abfällen erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Unternehmens in Bezug auf seine Schadstoffemissionen und seine Abfallwirtschaft. Der Umgang mit Schadstoffemissionen umfasst eine Bewertung der Bemühungen zur Kontrolle und Verringerung der Menge giftiger und krebserregender Nebenprodukte im Rahmen der Geschäftstätigkeit, Trends bei der Schadstofffreisetzung sowie messbare, zeitlich begrenzte Zielvorgaben zur Reduzierung von Schadstoffemissionen.

Verstöße gegen UNGC-Grundsätze (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS schließt Unternehmen, die an schweren Menschenrechtsverletzungen beteiligt sind, aus allen nachhaltigen Anlagestrategien aus.

Fehlende Prozesse zur Überwachung der Einhaltung des UNGC

Dieser Datenpunkt ist derzeit nicht Bestandteil der JSS-Nachhaltigkeitsmatrix. JSS wird diesen PAI in den nachhaltigen Investitionsprozess einbeziehen, sobald die Offenlegungsquoten ausreichend

sind. In der Zwischenzeit erfolgt eine ESG-Überwachung, bei der unter anderem regelmäßige Screenings auf Verstöße gegen die UNGC-Vorgaben durchgeführt werden. JSS strebt eine Berücksichtigung dieses Indikators an, sobald sich die Datenzuverlässigkeit und -verfügbarkeit verbessern.

Engagement in umstrittenen Waffen (für Ausschlüsse berücksichtigt)

JSS wird seiner Verantwortung in Bezug auf umstrittene Waffen aktiv gerecht, indem es sie konzernweit ausschließt. JSS investiert keine Eigenmittel in Wertpapiere von Unternehmen, die im Bereich der umstrittenen Waffen tätig sind. Ferner übernimmt JSS keine Vermögensverwaltungs- oder Anlageberatungsdienstleistungen für solche Unternehmen bzw. keine Dienstleistungen im Zusammenhang mit Kapitalmärkten oder Fusionen und Übernahmen.

Staaten

THG-Emissionsintensität (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die externen Umweltkosten eines Landes. Bewertet werden unter anderem die Treibhausgasemissionen pro Kopf.

Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (in der Nachhaltigkeitsmatrix berücksichtigt)

Für das ESG-Rating von JSS für Staaten erfasst die JSS-Nachhaltigkeitsmatrix die Leistung eines Landes in Bezug auf Grundrechte.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 01.07.2023 – 30.06.2024

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
ALSO HOLDING AG-REG	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	6,38	CH
BACHEM HOLDING AG	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	5,91	CH
SIKA AG-REG	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	5,27	CH
SKAN GROUP AG	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	4,49	CH
BELL FOOD GROUP AG - REG	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,91	CH
DAETWYLER HOLDING AG-BR	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,67	CH
SIG GROUP AG	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,58	CH
BELIMO HOLDING AG-REG	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,46	CH
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,34	CH
LEM HOLDING SA-REG	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,29	CH
BOSSARD HOLDING AG-REG A	Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	3,25	CH
FORBO HOLDING AG-REG	Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen	2,94	CH
BURKHALTER HOLDING AG	Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	2,83	CH

Hauptinvestitionen per 30.06.2024 (Ende des Geschäftsjahres). Keine bedeutenden Abweichungen über das Geschäftsjahr.

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

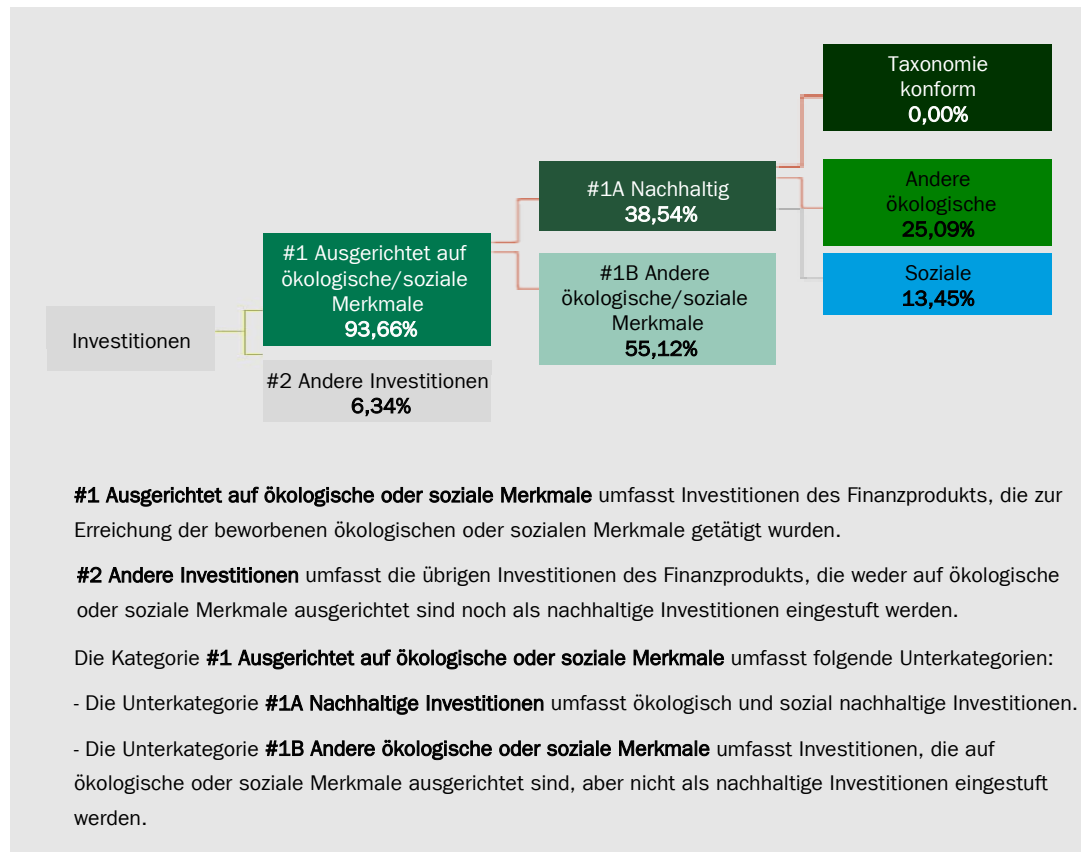


Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen betrug 38,54%. 25,09% der Investitionen des Finanzprodukts waren ökologisch nachhaltige Investitionen, und 13,45% der Investitionen des Finanzprodukts waren sozial nachhaltige Investitionen. Die Anteile werden auf der Grundlage des Marktwerts aller Positionen des Portfolios berechnet.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?



Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.

In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Bezeichnung des Sektors	Anteil der Investitionen
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren	21,20%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Maschinenbau	11,55%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Beteiligungsgesellschaften	10,07%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Datenverarbeitungsgeräten, elektronischen und optischen Erzeugnissen	7,79%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Nahrungs- und Futtermitteln	6,60%
Finanz- und Versicherungsdienstleistungen – Fondsmanagement	6,24%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von pharmazeutischen Grundstoffen	5,91%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Klebstoffen	5,27%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Wellpapier und -pappe sowie von Verpackungsmitteln aus Papier, Karton und Pappe	3,58%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Metallerzeugnissen	3,25%
Handel; Instandhaltung und Reparatur von Kraftfahrzeugen – Einzelhandel (ohne Handel mit Kraftfahrzeugen)	2,94%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Kunststoffen in Primärformen	2,64%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von sonstigen Waren	2,48%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von elektrischen Ausrüstungen	2,35%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Hebezeugen und Fördermitteln	2,31%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von hydraulischen und pneumatischen Komponenten und Systemen	2,09%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Maschinen für sonstige bestimmte Wirtschaftszweige a. n. g.	1,40%
Verarbeitendes Gewerbe/Herstellung von Waren – Herstellung von Mess-, Kontroll-, Navigations- und ähnlichen Instrumenten und Vorrichtungen	1,20%
Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie – Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,59%
Andere	0,56%

Aufschlüsselung nach dem prozentualen Anteil am gesamten Nettovermögen.

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf erneuerbare Energie oder CO2-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** enthalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Nicht zutreffend; dieses Finanzprodukt hat sich nicht zu einem Mindestanteil an nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel verpflichtet, die mit der EU-Taxonomie konform sind.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert(1)?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

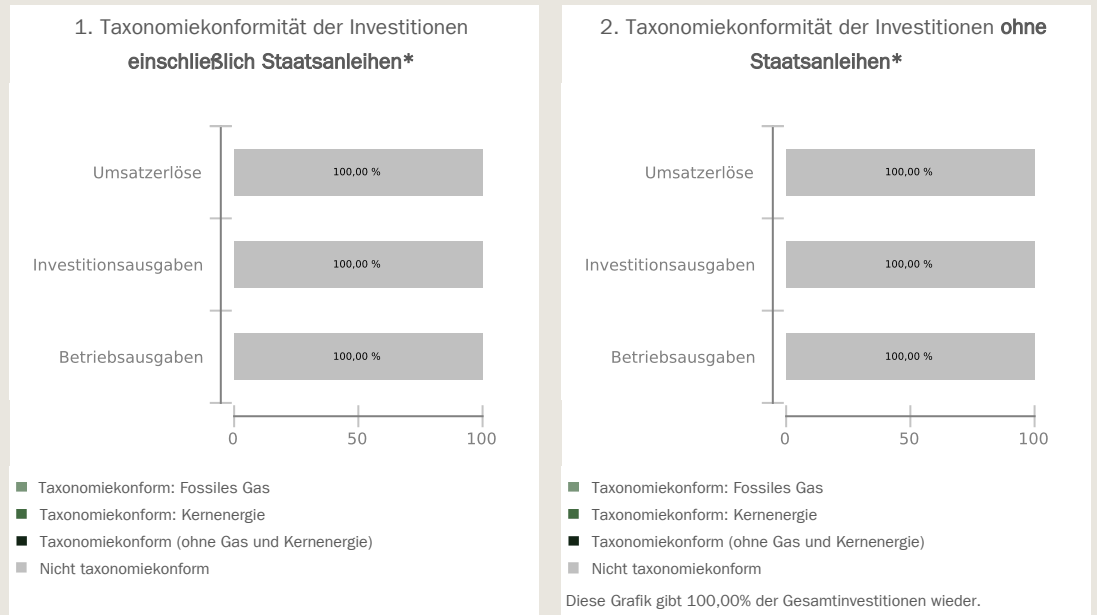
Nein

(1) Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.
- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.
- **Betriebsausgaben** (OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten geflossen sind: 0,00%

Anteil der Investitionen, die in ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind: 0,00%

● **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Prozentualer Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen

0,00%



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die **Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden?

Anteil der nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden: 25,09%

Diese Investitionen können mit der EU-Taxonomie konform sein; allerdings ist der Anlageverwalter gegenwärtig nicht in der Lage, den Anteil der zugrundeliegenden Investitionen des Finanzprodukts, berechnet gemäß der EU-Taxonomie, genau anzugeben. Diese Position wird jedoch weiterhin geprüft, während die zugrundeliegenden Regelungen im Laufe der Zeit fertiggestellt und mehr zuverlässige Daten verfügbar werden.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen: 13,45%



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Barmittel und Derivate des Produkts waren in der Rubrik „#2 Andere Investitionen“ enthalten und dienten hauptsächlich der Absicherung gegen Risiken. Derzeit gibt es keine anerkannte Methode für die Berücksichtigung von ESG-Kriterien für diese Anlageklassen. Außerdem waren Investitionen enthalten, die aufgrund unzureichender Daten nicht als auf ökologische und soziale Merkmale ausgerichtet betrachtet werden können. Der Mindestschutz besteht darin, dass diese Investitionen den Ausschlussrichtlinien von JSS entsprechen und die festgelegten Umsatzschwellen nicht überschritten werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlagestrategie des Produkts folgte einem rigorosen Verfahren, bei dem durchgängig ESG-Aspekte berücksichtigt wurden. Der Anlageverwalter wendete bei seiner Strategie die folgenden verbindlichen Kriterien an:

(a) Ausschluss von Anlagen in umstrittenen Geschäftsaktivitäten gemäß den Ausschlussrichtlinien von JSS;

(b) Erreichung eines überdurchschnittlichen ESG-Profiles. Dieses Produkt investierte nicht in mit C oder D bewertete Emittenten.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

● *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Nicht zutreffend, es wurde kein spezieller Index als Referenzwert bestimmt.

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.